

东方成长收益平衡混合型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 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：二〇一七年八月二十四日

§ 1 重要提示

1.1 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 2017 年 8 月 22 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。

本基金由东方保本混合型开放式证券投资基金（以下简称“东方保本”）转型而来，东方保本的保本周期为三年，于 2014 年 5 月 5 日起进入第二个保本周期，并于 2017 年 5 月 5 日到期。因未能符合保本基金存续条件，东方保本按照基金合同的约定转型为非保本的混合型基金，即“东方成长收益平衡混合型证券投资基金”。基金托管人及基金登记机构保持不变，基金代码沿用东方保本的基金代码“400013”。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、估值方法、基金费率等相关内容按照《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》的相关约定进行运作。上述转型事项已按照法律法规的规定及基金合同的约定履行相应程序，详见 2017 年 4 月 20 日、2017 年 4 月 21 日及 2017 年 4 月 27 日在公司官网发布的相关公告。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。其中，自 2017 年 5 月 5 日（含）起至 2017 年 5 月 10 日（含）止为东方保本混合型开放式证券投资基金保本周期到期期间，并自 2017 年 5 月 11 日起，东方保本混合型开放式证券投资基金正式转型为东方成长收益平衡混合型证券投资基金。本报告按基金转型前后的两个报告期进行编制。其中，基金转型前的报告期间为 2017 年 01 月 01 日起至 2017 年 5 月 10 日止，基金转型后的报告期为 2017 年 5 月 11 日起至 2017 年 6 月 30 日。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	东方成长收益平衡混合型证券投资基金
基金简称	东方成长收益平衡
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	2017 年 5 月 11 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	228, 197, 637. 53 份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	东方保本混合型开放式证券投资基金
基金简称	东方保本混合
基金主代码	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	230, 532, 403. 63 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	力争在股票、债券、现金等大类资产的适度平衡配置下，有效控制投资组合的风险，追求长期资本增值和稳定收益。
投资策略	本基金将充分发挥基金管理人的研究优势，将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上，动态调整投资组合比例，自上而下灵活配置资产；通过把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化，挖掘预期具有良好增长前景的优势行业；结合定量筛选与定性分析，精选个股，以谋求超额收益。
业绩比较基准	沪深 300 相对成长指数收益率×55%+中证全债指数收益率×45%。
风险收益特征	本基金属于混合型基金，为证券投资基金中的风险适中品种。长期平均的风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

2.2 基金产品说明（转型前）

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，在保本周期到期时，为保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	<p>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。</p> <p>在保本资产投资方面，以追求本金安全为目的。即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。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	<p>本基金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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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	李景岩	田东辉
	联系电话	010-66295888	010-68858113
	电子邮箱	xxpl@orient-fund.com	tiantonghui@psbc.com
客户服务电话		010-66578578 或 400-628-5888	95580
传真		010-66578700	010-68858120

注册地址	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区金融大街 3 号
办公地址	北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码	100033	100808
法定代表人	崔伟	李国华

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	
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.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

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年 5 月 11 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
本期已实现收益	2,446,882.30
本期利润	3,028,214.36
加权平均基金份额本期利润	0.0132
本期基金份额净值增长率	1.11%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年 6 月 30 日
期末可供分配基金份额利润	0.2035
期末基金资产净值	268,997,022.45
期末基金份额净值	1.179

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。

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 5 月 10 日
本期已实现收益	-7,646,721.37
本期利润	1,656,838.30
加权平均基金份额本期利润	0.0041
本期基金份额净值增长率	0.69%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年 5 月 10 日
期末可供分配基金份额利润	0.1928
期末基金资产净值	268,702,467.04
期末基金份额净值	1.1660

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。

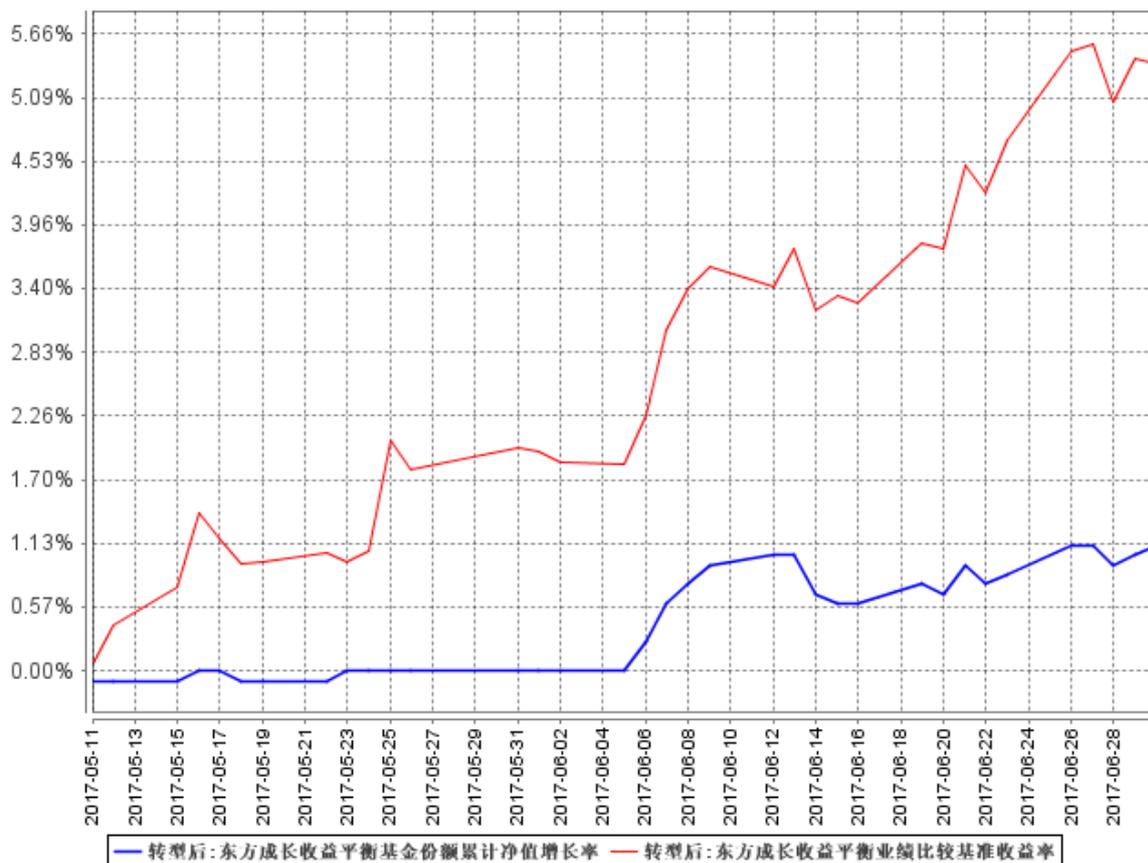
3.2 基金净值表现（转型后）

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
过去一个月	1.11%	0.16%	3.34%	0.37%	-2.23%	-0.21%
过去三个月	1.11%	0.13%	5.39%	0.36%	-4.28%	-0.23%
过去六个月	1.11%	0.13%	5.39%	0.36%	-4.28%	-0.23%
过去一年	1.11%	0.13%	5.39%	0.36%	-4.28%	-0.23%
过去三年	1.11%	0.13%	5.39%	0.36%	-4.28%	-0.23%
自基金合同生效起至今	1.11%	0.13%	5.39%	0.36%	-4.28%	-0.23%

3.2.2 自基金转型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

东方成长收益平衡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



注：本基金于 2017 年 5 月 11 日基金转型，截至报告期末，转型后基金合同生效不满六个月，仍处于建仓期。

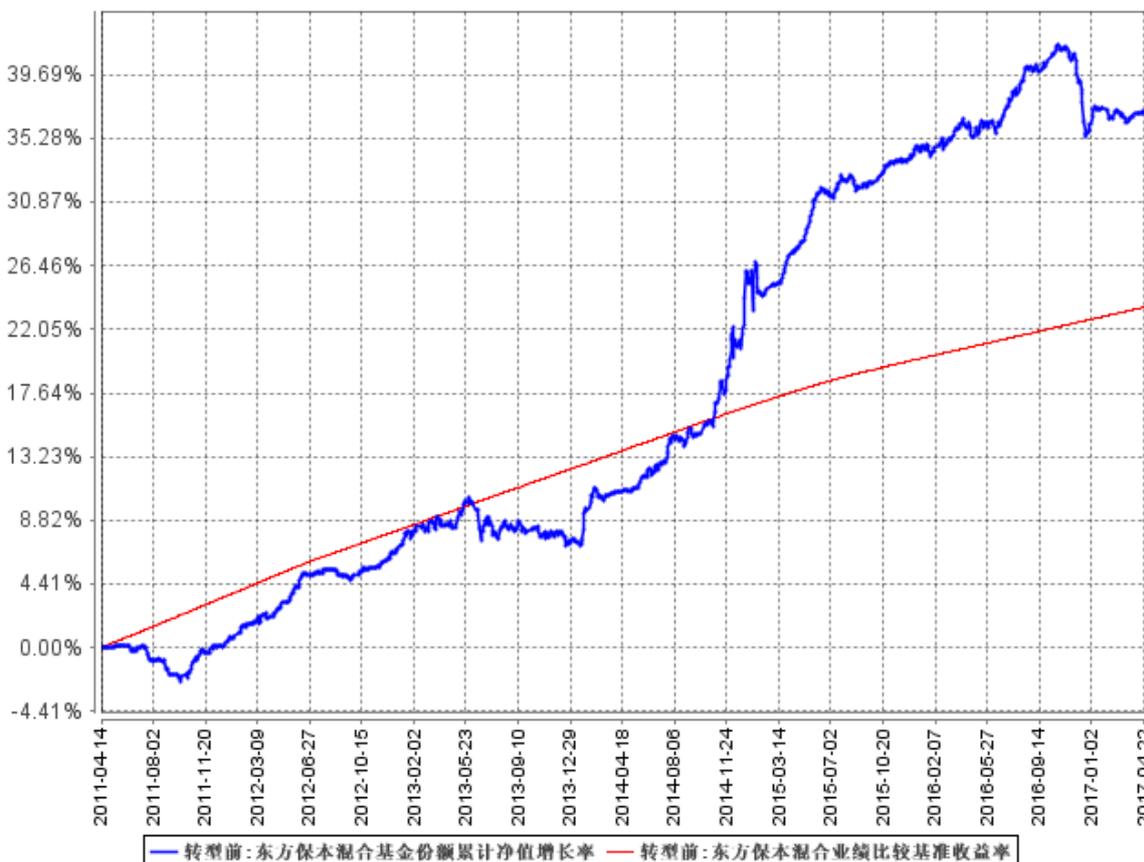
3.2 基金净值表现（转型前）

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	0.26%	0.04%	0.30%	0.01%	-0.04%	0.03%
过去六个月	0.69%	0.09%	0.98%	0.01%	-0.29%	0.08%
过去一年	0.26%	0.14%	2.36%	0.01%	-2.10%	0.13%
过去三年	21.81%	0.22%	9.21%	0.01%	12.60%	0.21%
自基金合同生效起至今	37.21%	0.18%	23.70%	0.01%	13.51%	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

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。截至2017年6月30日，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%。截至2017年6月30日，本公司管理44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、东方成长收益平衡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、东方大健康混合型证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方荣家保本混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金、东方合家保本混合型证券投资基金、东方臻馨债券型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方永熙18个月定期开放债券型证券投资基金、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方臻悦纯债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
姚航	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 9 月 25 日	-	13 年	中国人民大学工商管理硕士,13 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、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方赢家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(于 2017 年 5 月 11 日起转型为东方成长收益平衡混合型基金)基金经理,现任固定收益部副总经理、投资决策委员会委员、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方成长收益平衡混合型基金基金经理、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、东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理。

王然	本基金基金经理	2015 年 4 月 30 日	-	9 年	<p>北京交通大学产业经济学硕士，9 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 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、东方赢家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（于 2017 年 5 月 11 日转型为东方成长收益平衡混合型基金）基金经理，现任东方成长收益平衡混合型基金基金经理、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、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定</p>
----	---------	-----------------	---	-----	--

					期开放混合型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
姚航	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 9 月 25 日	-	13 年	中国人民大学工商管理硕士，13 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、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方赢家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(于 2017 年 5 月 11 日起转型为东方成长收益平衡混合型基金)基金经理，现任固定收益部副总经理、投资决策委员会委员、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方成长收益平衡混合型基金基金经理、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、东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理。
王然	本基金基金经理	2015 年 4 月 30 日	-	9 年	<p>北京交通大学产业经济学硕士，9 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、东方赢家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（于 2017 年 5 月 11 日转型为东方成长收益平衡混合型基金）基金经理，现任东方成长收益平衡混合型基金基金经理、东方策略成长混合型开放</p>

					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、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《东方成长收益平衡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内的公平交易程序；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 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

从基本面来看，2017 年上半年经济表现平稳、韧性较强。具体而言，房地产开发投资增长受益于三四线去库存、棚改货币化，基建投资增长受益于年初信贷投放规模大、财政支出节奏快；实体经济在此带动下出现了一定程度的库存去化，从而带动 6 月以来补库存迹象，此外 PMI 连续保持在 50 以上的景气区间，印证了内需表现较好。

从政策面来看，2017 年上半年各金融监管机构密集发布文件，去杠杆思路明确，央行方面，一季度先后上调 OMO、MLF 等政策利率，二季度以来通过公开市场操作紧控流动性投放，贯穿着“稳健中性”的货币政策思路。在此背景下，2017 年上半年债券收益率震荡上行，十年国开债较年初上行近 50BP。较强的基本面制约了债券收益率下行，市场关注的焦点主要聚焦于金融监管政策及流动性。

报告期内，市场在 3000-3300 点之间宽幅震荡，1 季度和 2 季度末的两波上涨主要是周期品短周期库存调整带来的，其中还叠加了三四线房地产销售超预期带来的相关产业链的数据超预期

行情。整体上看，上证综指上涨 2.86%、深圳成指上涨 3.46%、创业板指下跌 7.34%，分化明显；而沪深 300 表现明显好于其他指数，上涨 10.78%，主要是绩优行业龙头有较好的表现，特别是一些消费品行业的龙头标的受到资金的追捧，在 6 月 A 股 222 只标的加入 MSCI 之后更有突出的表现。

从整个上半年的情况看，基本符合我们年初的判断，即在三四线房地产去库存的背景下，家电、家具等相关产业链均有较好的增长表现，使得行业龙头业绩靓丽带动股价上涨。另外 2 季度以来，人民币汇率走稳，海外市场也有较好的表现，A 股纳入 MSCI 如期兑现，使得龙头白马股加速上行。wind 数据显示，上半年银行、建筑装饰、电子、家电、轻工等行业涨幅明显，而农业、纺织服装、商业零售、传媒、房地产行业跌幅居前。

报告期内，根据保本基金的有关规定，本基金结束了上一个保本周期，并转型调整为混合型基金，基金名称、投资范围和投资策略也相应发生了一些变化。目前该基金仍处于转型调整阶段，以享受票息为主，股票仓位比较低，以低估值蓝筹股为主，严格控制回撤。上半年本基金在市场大幅震荡过程中恰当的规避了风险，并且取得了一定的正收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 5 月 10 日，转型前基金（东方保本混合型开放式证券投资基金）净值增长率为 0.69%，业绩比较基准增长率为 0.98%，低于业绩比较基准 0.29%。2017 年 5 月 11 日起至 2017 年 6 月 30 日，转型后基金（东方成长收益平衡混合型证券投资基金）净值增长率为 1.11%，业绩比较基准增长率为 5.39%，低于业绩比较基准 4.28%。

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 3 季度，美国经济总体稳定，缩表与加息路径较明确；欧洲经济复苏加速，开始考虑宽松政策的退出；日本经济温和复苏，通胀有所上升，将维持货币宽松不变；新兴经济体上半年复苏好转，下半年挑战仍存。整体看，全球经济复苏为我国提供了良好的外部环境，非美货币走强缓解了人民币兑美元贬值压力，资本流出明显放缓。

国内市场方面，货币增速放缓、金融加强监管特别是积极落实第五次全国金融工作会议精神，重点引导金融资源回归服务实体经济本源。财政政策推进减费降税，防范地方债务风险，助力供给侧改革；货币政策保持稳健中性，强化监管的统一性与协调性。房地产没有想象中那么差，库存去化非常快，下半年开工没那么悲观。3 月份 87 号文打压了国内基建，特别是 PPP，但是各地方又出台了鼓励一带一路相关项目的指导意见。供给侧改革仍是持续推进的重点，2016 年是煤炭，2017 年是钢铁，下半年要看电解铝的供给收缩。未来制造业的重点是产能整合、技术升级和环保对制造业的要求不断提升。另外，消费相关行业仍可关注 CPI 上行以及年底的估值切换。整体上

看，第 3 季度市场震荡加剧、结构继续分化，绩优行业龙头仍受追捧。预计国内经济呈现前高后低的态势，增速小幅下台阶，低而不崩，资金约束或将成为基建、地产投资大幅增长的桎梏，预计出口、制造业投资仍保持在相对景气区间，受益于外需回暖、库存周期、价格回暖等因素。

对于 2017 年下半年债券市场而言，短期来看，央行维稳资金面、但金融去杠杆的大背景下利率中枢难以出现大幅下移，三季度仍面临较大规模的同业存单到期、委外收缩和赎回压力；长期来看，随着经济缓慢下台阶、实体融资压力加大，政策或适度呵护，债券可期待基本面重新转弱后的机会。

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。

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)。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定, 结合本基金实际运作情况, 本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 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份额持有人数量低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》与《东方成长收益平衡混合型证券投资基金托管协议》，自 2011 年 4 月 14 日起托管东方成长收益平衡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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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半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 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

6.1 资产负债表（转型后）

会计主体：东方成长收益平衡混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 6 月 30 日
资 产：	
银行存款	4,123,196.91
结算备付金	231,371.47
存出保证金	137,218.48
交易性金融资产	200,589,104.00
其中：股票投资	34,274,608.20
基金投资	-
债券投资	166,314,495.80
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	100,000,510.00
应收证券清算款	-
应收利息	1,342,413.74
应收股利	-
应收申购款	721.69
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	306,424,536.29
负债和所有者权益	本期末 2017 年 6 月 30 日
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	34,299,862.85
应付证券清算款	-
应付赎回款	111,854.31
应付管理人报酬	331,194.56
应付托管费	55,199.09
应付销售服务费	-

应付交易费用	1,366,559.07
应交税费	-
应付利息	4,744.35
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	1,258,099.61
负债合计	37,427,513.84
所有者权益：	
实收基金	205,831,051.24
未分配利润	63,165,971.21
所有者权益合计	268,997,022.45
负债和所有者权益总计	306,424,536.29

注：①报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.179 元，基金份额总额 228,197,637.53 份。

②本基金基金合同于 2017 年 5 月 11 日生效，无可比期间数据，本报告实际报告期为 2017 年 5 月 11 日至 2017 年 6 月 30 日，下同。

6.2 利润表

会计主体：东方成长收益平衡混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 5 月 11 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 5 月 11 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
一、收入	3,908,641.63
1. 利息收入	1,252,493.93
其中：存款利息收入	197,640.03
债券利息收入	586,461.59
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	468,392.31
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	2,070,763.50
其中：股票投资收益	1,970,625.27
基金投资收益	-
债券投资收益	-205,720.37
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-

股利收益	305,858.60
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	581,332.06
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	4,052.14
减：二、费用	880,427.27
1. 管理人报酬	562,552.91
2. 托管费	93,758.82
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	163,349.40
5. 利息支出	11,862.24
其中：卖出回购金融资产支出	11,862.24
6. 其他费用	48,903.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	3,028,214.36
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	3,028,214.36

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方成长收益平衡混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 5 月 11 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 5 月 11 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 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）	207,936,977.34	60,765,489.70	268,702,467.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,028,214.36	3,028,214.36
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）	-2,105,926.10	-627,732.85	-2,733,658.95
其中：1. 基金申购款	333,074.46	98,848.90	431,923.36
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-2,439,000.56	-726,581.75	-3,165,582.31
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）	205,831,051.24	63,165,971.21	268,997,022.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘鸿鹏</u>	<u>刘鸿鹏</u>	<u>肖向辉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

东方成长收益平衡混合型证券投资基金由东方保本混合型开放式证券投资基金转型而来。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。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，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。本基金的保本周期为三年，于 2014 年 5 月 5 日起进入第二个保本周期，并于 2017 年 5 月 5 日到期。因未能符合保本基金存续条件，本基金按照基金合同的约定转型为非保本的混合型基金，即“东方成长收益平衡混合型证券投资基金”。基金托管人及基金登记机构保持不变，基金代码沿用东方保本的基金代码“400013”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，东方成长收益平衡混合型证券投资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（包括国债、央行票据、企业债、公司债、金融债、可转换债券、短期融资券、资产支持证券及其他法律法规或中国证监会允许投资的债券类金融工具）、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。东方成长收益平衡混合型证券投资基金各类资产的投资比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的 40%-80%，其中，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的 20%-60%，其中，现金及到期日不超过 1 年的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

6.4.2 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 3 号—半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。

6.4.3 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 5 月 11 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本会计期间为 2017 年 5 月 11 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成本基金的金融资产，并形成其他单位的金融负债或权益工具的合同。

1. 金融资产的分类

金融资产应当在初始确认时划分为以下四类：（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；（2）持有至到期投资；（3）贷款和应收款项；（4）可供出售金融资产。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资、同业存单和衍生工具（主要为权证投资）。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。

本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

2. 金融负债的分类

金融负债应当在初始确认时划分为以下两类：（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；（2）其他金融负债。

本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券、同业存单以及不作为有效套期工具的衍生工具等，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以成本进行后续计量，在摊销时产生的利得或损失，应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

（1）股票投资

股票投资成本按交易日股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利（包括送红股和公积金转增股本）以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

（2）债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转债，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于债券部分的成本。

买入零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含报酬率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3) 权证投资

权证投资于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转债而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

(5) 买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始成本。买入返售金融资产于返售到期日按账面余额结转。

(6) 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始成本。卖出回购金融资产款于回购到期日按账面余额结转。

(7) 同业存单

同业存单视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含报酬率后，逐日确认债券利息收入。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，基金管理公司根据具体情况与托管银行进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

国家有最新规定的，按其规定进行估值。

具体投资品种的估值方法如下：

(1) 股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

本基金对于长期停牌股票，根据 2008 年 09 月 12 日证监会发布的【2008】38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，因最近交易日后经济环境发生了重大变化，以参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素(如指数收益法)，调整最近交易市价，确定公允价值。

由于上市公司送股、转增股、配股和公开增发新股等形成的流通暂时受限制的股票投资，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值。

首次公开发行但未上市股票采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。首次公开发行有明确锁定期的股票，于同一股票上市后按交易所上市同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(2) 债券投资

①证券交易所上市实行净价交易的债券按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。

②证券交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值。

③发行未上市流通的债券，按成本估值。

④同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

⑤在全国银行间债券市场交易的债券，采用估值技术确定公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量。

(3) 权证投资

①证券交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价估值。

②首次发行但尚未上市的权证在上市交易前，采用估值技术确定公允价值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量。

③因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

④因认购或获配新发行的分离交易可转债而取得的债券和权证，上市日前，分别按照中国证券业协会公布的债券报价和权证报价确定当日债券和权证的估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述相关原则进行估值。

(4) 资产支持证券等其他有价证券按国家有关规定进行估值。

(5) 同业存单根据其交易场所，采用相应的估值技术确定公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金单位总额所对应的金额。由于申购、赎回、转换以及分红再投资引起的实收基金的变动分别于基金相关活动确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于月末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债及同业存单视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

同业存单投资收益于交易日按卖出同业存单交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

(3) 公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提并确认。

(2) 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提并确认。

(3) 卖出回购金融资产利息支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提并确认。

(4) 交易费用

进行股票、债券、同业存单、权证等交易过程中产生的交易费用，在发生时按照确定的金额计入交易费用。

(5) 其他费用

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1. 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%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2. 基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3. 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4. 每一基金份额享有同等分配权；

5. 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

6. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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入，暂不缴纳营业税和企业所得税。
3. 基金取得的股票股息、红利收入，自 2015 年 9 月 8 日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
5. 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 09 月 19 日起，由出让方按 0.1% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年5月11日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东北证券股份有限公司	118,390,367.24	100.00%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年5月11日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	回购成交金额	占当期回购债券 成交总额的比例
东北证券股份有限公司	47,631,821.49	100.00%

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年5月11日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
东北证券股份有限公司	40,000,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期 2017 年 5 月 11 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年5月11日(基金合同生效日)至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东北证券股份有 限公司	108,788.17	100.00%	1,356,506.55	100.00%

注：①上述佣金按照市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

②该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年5月11日(基金合同生效日)至2017年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	50,687.59

注：①计提标准：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，按月支付，由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 5 月 11 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	93,758.82

注：①计提标准：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，按月支付，由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期 2017 年 5 月 11 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日，未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2017 年 5 月 11 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
基金合同生效日持有的基金份额	-

期初持有的基金份额	8,888,000.00
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	8,888,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.89%

注：根据《东方保本混合型开放式证券投资基金招募说明书》中对申购费用的规定，申购金额大于或等于 500 万元的，申购费用为 1000 元/笔。基金管理人运用自有资金投资本基金适用的申购费用为 1000 元/笔。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 5 月 11 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	4,123,196.91	44,043.89

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期 2017 年 5 月 11 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日，未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 34,299,862.85 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
111720130	17 广发银行 CD130	2017 年 7 月 3 日	98.93	350,000	34,625,500.00
合计				350,000	34,625,500.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本半年度报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表（转型前）

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：2017 年 5 月 10 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 5 月 10 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	271,974,055.49	2,876,213.25
结算备付金	-	907,143.63
存出保证金	125,902.98	112,087.53
交易性金融资产	-	531,410,109.04
其中：股票投资	-	57,143,909.94
基金投资	-	-
债券投资	-	474,266,199.10
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	6,541,541.80
应收利息	50,597.57	10,464,788.11
应收股利	-	-
应收申购款	-	31,150.49
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	272,150,556.04	552,343,033.85
负债和所有者权益	本期末 2017 年 5 月 10 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	50,000,000.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	931,183.81	56,333.69
应付管理人报酬	49,211.43	555,925.44
应付托管费	7,570.98	85,526.98
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,250,029.78	1,153,726.60
应交税费	-	-

应付利息	-	26,829.56
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,210,093.00	1,234,287.90
负债合计	3,448,089.00	53,112,630.17
所有者权益：		
实收基金	207,936,977.34	388,713,502.68
未分配利润	60,765,489.70	110,516,901.00
所有者权益合计	268,702,467.04	499,230,403.68
负债和所有者权益总计	272,150,556.04	552,343,033.85

注：报告截止日 2017 年 5 月 10 日，基金份额净值 1.166 元，基金份额总额 230,532,403.63 份。

6.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 5 月 10 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 5 月 10 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入	4,556,429.17	12,324,408.59
1. 利息收入	7,584,716.11	9,989,941.61
其中：存款利息收入	154,077.59	107,745.96
债券利息收入	5,240,603.33	8,871,384.34
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,190,035.19	1,010,811.31
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-12,857,281.62	6,646,391.89
其中：股票投资收益	5,391,074.32	2,069,775.72
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-18,246,855.94	4,464,626.97
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-1,500.00	111,989.20
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	9,303,559.67	-4,940,907.67
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	525,435.01	628,982.76

减：二、费用	2,899,590.87	5,505,202.41
1. 管理人报酬	2,109,617.34	3,928,179.51
2. 托管费	324,556.53	604,335.28
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	209,659.29	347,407.81
5. 利息支出	112,300.71	441,438.67
其中：卖出回购金融资产支出	112,300.71	441,438.67
6. 其他费用	143,457.00	183,841.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,656,838.30	6,819,206.18
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,656,838.30	6,819,206.18

6.3 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 5 月 10 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 5 月 10 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）	388,713,502.68	110,516,901.00	499,230,403.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,656,838.30	1,656,838.30
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）	-180,776,525.34	-51,408,249.60	-232,184,774.94
其中：1. 基金申购款	233,579,613.21	67,677,061.31	301,256,674.52
2. 基金赎回款	-414,356,138.55	-119,085,310.91	-533,441,449.46
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）	207,936,977.34	60,765,489.70	268,702,467.04
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	788,353,700.16	212,654,593.44	1,001,008,293.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,819,206.18	6,819,206.18
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）	-402,360,214.88	-107,772,415.94	-510,132,630.82
其中：1. 基金申购款	5,624,520.39	1,568,472.11	7,192,992.50
2. 基金赎回款	-407,984,735.27	-109,340,888.05	-517,325,623.32
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）	385,993,485.28	111,701,383.68	497,694,868.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘鸿鹏</u>	<u>刘鸿鹏</u>	<u>肖向辉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 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 3 号—半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。

6.4.3 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 2017 年 5 月 10 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 5 月 10 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 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、会计估计与最近一期年度报告保持一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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入，暂不缴纳营业税和企业所得税。
3. 基金取得的股票股息、红利收入，自 2015 年 9 月 8 日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。
4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
5. 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 09 月 19 日起，由出让方按 0.1% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。
6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

东北证券股份有限公司	本基金管理人股东、销售机构
东方基金管理有限责任公司	本基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	本基金托管人、销售机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年5月10日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
东北证券股份有限公司	114,610,908.95	100.00%	224,918,605.57	100.00%

6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年5月10日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
东北证券股份有限公司	205,871,739.94	100.00%	151,312,338.78	100.00%

6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年5月10日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例

东北证券股份有限公司	827,500,000.00	100.00%	2,126,800,000.00	100.00%
------------	----------------	---------	------------------	---------

6.4.7.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年5月10日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东北证券股份有限公司	106,632.40	100.00%	1,247,718.38	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东北证券股份有限公司	207,068.39	100.00%	844,385.31	100.00%

注：①上述佣金按照市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

②该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.7.1.6 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年5月10日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,109,617.34
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	110,108.18	165,005.87

注：①计提标准：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.3%年费率计提。管理费的计算

方法如下：

$$H = E \times 1.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

③保本周期内，保证费用由基金管理人从基金管理费收入中列支。

6.4.7.1.7 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 5 月 10 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	324,556.53	604,335.28

注：①计提标准：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期						
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 5 月 10 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间						
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日						

银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	-	-	-	55,000,000.00	17,931.51

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.1.8 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年5月10日	2016年1月1日至2016年6月30日
基金合同生效日持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	8,888,000.00	8,888,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	8,888,000.00	8,888,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.86%	2.08%

注：根据《东方保本混合型开放式证券投资基金招募说明书》中对申购费用的规定，申购金额大于或等于 500 万元的，申购费用为 1000 元/笔。基金管理人运用自有资金投资本基金适用的申购费用为 1000 元/笔。

6.4.7.1.9 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年5月10日		2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	271,974,055.49	97,194.87	18,714,298.88	86,868.48

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.9 期末（2017 年 5 月 10 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.1.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 5 月 10 日止，本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.8.1.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 5 月 10 日止，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本半年度报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告（转型后）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	34,274,608.20	11.19
	其中：股票	34,274,608.20	11.19
2	固定收益投资	166,314,495.80	54.28
	其中：债券	166,314,495.80	54.28
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	100,000,510.00	32.63
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,354,568.38	1.42
7	其他各项资产	1,480,353.91	0.48
8	合计	306,424,536.29	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,231,900.00	3.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,592,500.00	2.08
E	建筑业	3,934,000.00	1.46
F	批发和零售业	1,130,500.00	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	9,885,108.20	3.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	3,150,000.00	1.17
K	房地产业	2,350,600.00	0.87

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	34,274,608.20	12.74

7.2.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600068	葛洲坝	350,000	3,934,000.00	1.46
2	600056	中国医药	140,000	3,633,000.00	1.35
3	600377	宁沪高速	349,909	3,429,108.20	1.27
4	601006	大秦铁路	400,000	3,356,000.00	1.25
5	600886	国投电力	400,000	3,160,000.00	1.17
6	601398	工商银行	600,000	3,150,000.00	1.17
7	600350	山东高速	500,000	3,100,000.00	1.15
8	603355	莱克电气	50,000	2,938,500.00	1.09
9	600995	文山电力	250,000	2,432,500.00	0.90
10	600340	华夏幸福	70,000	2,350,600.00	0.87

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

7.3 报告期内股票投资组合的重大变动

7.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	7,164,353.40	2.67
2	000333	美的集团	5,523,879.00	2.06
3	600068	葛洲坝	3,708,082.00	1.38

4	300296	利亚德	3,520,732.16	1.31
5	600056	中国医药	3,485,891.00	1.30
6	002508	老板电器	3,430,546.20	1.28
7	600377	宁沪高速	3,393,027.94	1.26
8	601006	大秦铁路	3,363,848.00	1.25
9	600886	国投电力	3,139,251.00	1.17
10	600350	山东高速	3,091,244.00	1.15
11	000065	北方国际	3,079,504.00	1.15
12	603355	莱克电气	2,927,318.00	1.09
13	002415	海康威视	2,795,531.36	1.04
14	000568	泸州老窖	2,580,535.00	0.96
15	600340	华夏幸福	2,468,587.71	0.92
16	600995	文山电力	2,432,545.00	0.91
17	000423	东阿阿胶	2,368,244.00	0.88
18	600258	首旅酒店	2,212,232.13	0.82
19	002027	分众传媒	2,042,462.00	0.76
20	000858	五粮液	1,796,998.00	0.67

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

②“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.3.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	6,253,383.93	2.33
2	601398	工商银行	4,167,947.70	1.55
3	300296	利亚德	3,708,844.00	1.38
4	002508	老板电器	3,480,722.10	1.30
5	002415	海康威视	3,003,168.00	1.12
6	000065	北方国际	2,924,295.00	1.09
7	000423	东阿阿胶	2,568,032.00	0.96
8	000568	泸州老窖	2,542,351.00	0.95
9	600258	首旅酒店	2,272,528.40	0.85
10	000858	五粮液	2,080,000.00	0.77
11	002027	分众传媒	2,009,684.85	0.75

12	000069	华侨城 A	1,868,000.00	0.70
13	300212	易华录	1,786,453.25	0.66
14	000895	双汇发展	1,607,326.00	0.60
15	300122	智飞生物	1,505,720.70	0.56
16	300072	三聚环保	1,470,605.00	0.55

注：①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.3.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	75,141,305.31
卖出股票收入（成交）总额	43,249,061.93

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,992,000.00	3.71
	其中：政策性金融债	9,992,000.00	3.71
4	企业债券	37,411,495.80	13.91
5	企业短期融资券	19,996,000.00	7.43
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	98,915,000.00	36.77
9	其他	-	-
10	合计	166,314,495.80	61.83

7.5 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111720130	17 广发银行 CD130	500,000	49,465,000.00	18.39
2	111707141	17 招商银行 CD141	500,000	49,450,000.00	18.38
3	041761010	17 吉安井开 CP001	200,000	19,996,000.00	7.43
4	122679	PR 河套债	224,380	16,920,495.80	6.29
5	124972	14 安高债	100,000	10,473,000.00	3.89

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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

7.11.2

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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	137,218.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,342,413.74
5	应收申购款	721.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,480,353.91

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 7 投资组合报告（转型前）

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	271,974,055.49	99.94
7	其他资产	176,500.55	0.06
8	合计	272,150,556.04	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600104	上汽集团	6,005,567.00	1.20
2	601169	北京银行	6,004,863.85	1.20
3	600036	招商银行	5,475,225.00	1.10
4	601800	中国交建	4,573,249.92	0.92
5	601333	广深铁路	4,342,782.70	0.87

6	603626	科森科技	47,030.75	0.01
7	603768	常青股份	44,961.60	0.01
8	603630	拉芳家化	36,504.15	0.01
9	603717	天域生态	36,428.70	0.01
10	603639	海利尔	30,089.70	0.01
11	603665	康隆达	25,359.00	0.01
12	300580	贝斯特	23,869.51	0.00
13	603178	圣龙股份	19,412.34	0.00
14	603628	清源股份	14,376.17	0.00
15	603578	三星新材	14,000.92	0.00
16	603089	正裕工业	12,641.81	0.00
17	603668	天马科技	12,513.15	0.00
18	603638	艾迪精密	11,021.50	0.00
19	603138	海量数据	10,949.04	0.00
20	603388	元成股份	10,781.10	0.00

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

②“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600298	安琪酵母	6,197,312.17	1.24
2	601169	北京银行	5,929,388.44	1.19
3	600104	上汽集团	5,836,480.00	1.17
4	600036	招商银行	5,645,012.46	1.13
5	600519	贵州茅台	5,636,684.59	1.13
6	600887	伊利股份	5,529,157.20	1.11
7	600350	山东高速	5,421,884.00	1.09
8	600872	中炬高新	5,178,652.80	1.04
9	603866	桃李面包	4,985,743.53	1.00
10	600688	上海石化	4,695,898.19	0.94
11	600276	恒瑞医药	4,505,707.95	0.90
12	601800	中国交建	4,282,566.44	0.86
13	601333	广深铁路	4,279,919.75	0.86
14	600643	爱建集团	4,131,063.00	0.83

15	600309	万华化学	3,492,100.00	0.70
16	603020	爱普股份	2,913,549.00	0.58
17	000521	美菱电器	2,700,306.20	0.54
18	601186	中国铁建	2,506,000.00	0.50
19	002570	贝因美	2,358,461.60	0.47
20	601375	中原证券	236,296.33	0.05

注：①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	26,751,627.91
卖出股票收入（成交）总额	88,209,220.48

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	125,902.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	50,597.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	176,500.55

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 8 基金份额持有人信息（转型后）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
5,989	38,102.79	181,152,427.21	79.38%	47,045,210.32	20.62%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2.49	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 8 基金份额持有人信息（转型前）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
6,128	37,619.52	181,152,427.21	78.58%	49,379,976.42	21.42%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2.49	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	230,532,403.63
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	369,267.94
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,704,034.04
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	228,197,637.53

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 9 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	1,868,943,721.33
本报告期期初基金份额总额	430,952,970.67
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	258,961,490.93
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	459,382,057.97
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	230,532,403.63

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

东方保本混合型开放式证券投资基金从 2017 年 5 月 11 日起正式转型为东方成长收益平衡混合型证券投资基金。转型后基金的投资目标、投资策略和业绩比较基准等按照《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》相关约定进行运作。前述修改变更事项已按照相关法律法规及基金合同的约定履行相关手续。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

东北证券股份有限公司	2118,390,367.24	100.00%	108,788.17	100.00%	-
------------	-----------------	---------	------------	---------	---

注：（1）此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

（2）交易单元的选择标准和程序：

券商选择标准：① 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③ 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④ 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥ 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦ 收取的佣金率。

券商选择程序：① 对符合选择标准的券商的服务进行评价；② 拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③ 签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

（3）本报告期内本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东北证券股份有限公司	47,631,821.49	100.00%	40,000,000.00	100.00%	-	-

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
东北证券股 份有限公司		2114,610,908.95	100.00%	106,632.40	100.00%	-

注：（1）此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

（2）交易单元的选择标准和程序：

券商选择标准：①资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；②财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；③经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；④内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；⑥研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；⑦收取的佣金率。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

（3）本报告期内本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
东北证券股 份有限公司	205,871,739.94	100.00%	827,500,000.00	100.00%	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-3-16 至 2017-6-30	172,264,427.21	-	-	172,264,427.21	75.49
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。</p> <p>(1) 当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，可能会导致本基金的流动性风险及相关冲击成本，可能造成基金净值的波动。</p> <p>(2) 当上述投资者赎回触发基金合同约定的巨额赎回情形时，基金管理人可以根据基金合同约定进行相应处理，可能会影响投资者赎回。</p>							

东方基金管理有限责任公司

2017 年 8 月 24 日