

# 东方安心收益保本混合型证券投资基金 2017 年年度报告 摘要

2017 年 12 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

送出日期：二〇一八年三月三十一日

## § 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 2018 年 3 月 28 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。

本报告期自 2017 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       | 东方安心收益保本           |
| 基金主代码      | 400020             |
| 前端交易代码     | 400020             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2013 年 7 月 3 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 | 1,087,835,809.87 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，控制本金损失的风险，并在基金本金安全的基础上实现基金资产的稳定增值。  |
| 投资策略   | 本基金将综合运用固定比例投资组合保险策略 (Constant Proportion Portfolio Insurance, 以下简称 CPPI 策略) 与基于期权的投资组合保险策略 (Option-Based Portfolio Insurance, 以下简称 OBPI 策略) 在保本周期内实现保值增值的目的。 |
| 业绩比较基准 | 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。  |
| 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           | tiandonghui@psbc.com |
| 客户服务电话  |      | 010-66578578 或<br>400-628-5888 | 95580                |
| 传真      |      | 010-66578700                   | 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<br>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

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2017 年           | 2016 年           | 2015 年           |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益       | -5,035,040.65    | 2,340,512.44     | 412,875,498.60   |
| 本期利润          | 10,867,692.42    | -38,336,769.91   | 417,916,542.44   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0085           | -0.0305          | 0.1517           |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.84%            | -1.56%           | 12.13%           |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017 年末          | 2016 年末          | 2015 年末          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1418           | 0.1435           | 0.1738           |
| 期末基金资产净值      | 1,070,789,856.55 | 1,782,368,289.11 | 1,399,538,536.75 |
| 期末基金份额净值      | 0.9843           | 0.9761           | 1.2711           |

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

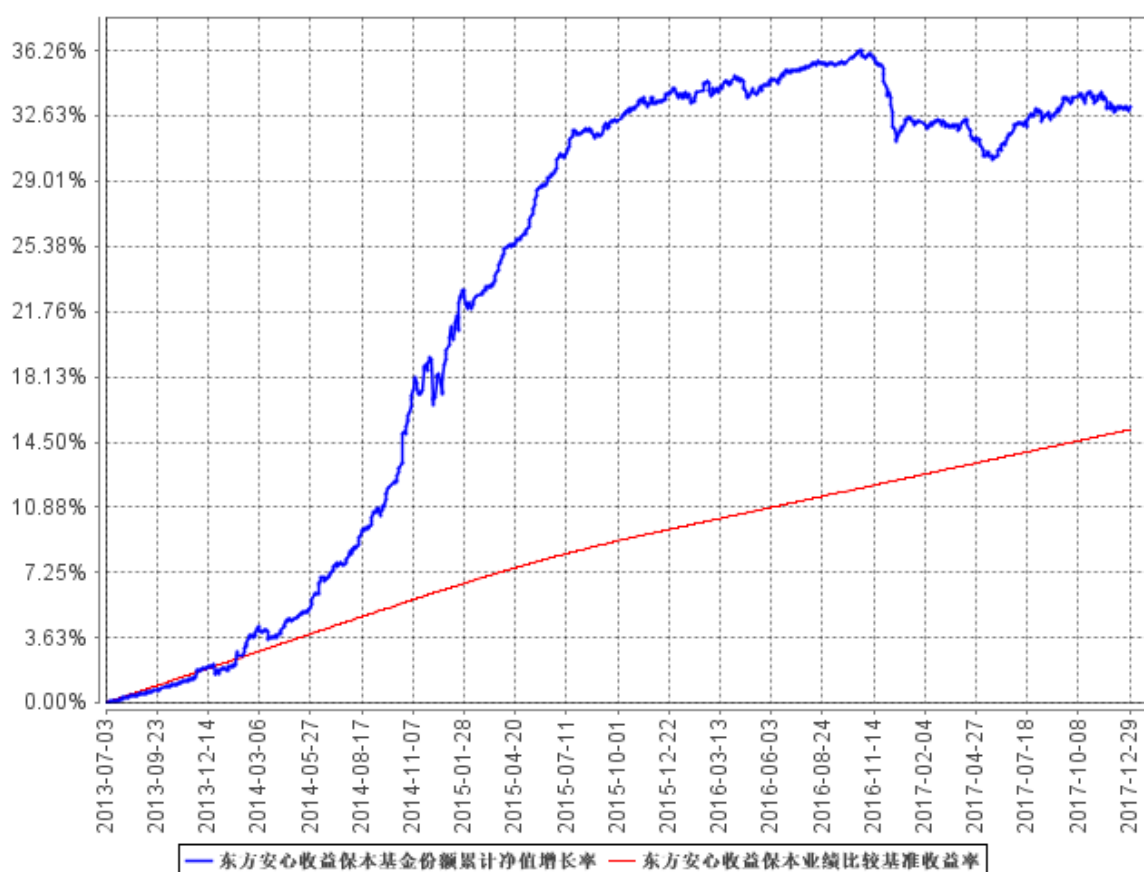
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | -0.39%   | 0.11%       | 0.69%      | 0.01%         | -1.08% | 0.10% |

|            |        |       |        |       |        |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 过去六个月      | 0.77%  | 0.10% | 1.39%  | 0.01% | -0.62% | 0.09% |
| 过去一年       | 0.84%  | 0.09% | 2.75%  | 0.01% | -1.91% | 0.08% |
| 过去三年       | 11.31% | 0.11% | 8.87%  | 0.01% | 2.44%  | 0.10% |
| 过去五年       | 33.15% | 0.14% | 15.21% | 0.01% | 17.94% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 33.15% | 0.14% | 15.21% | 0.01% | 17.94% | 0.13% |

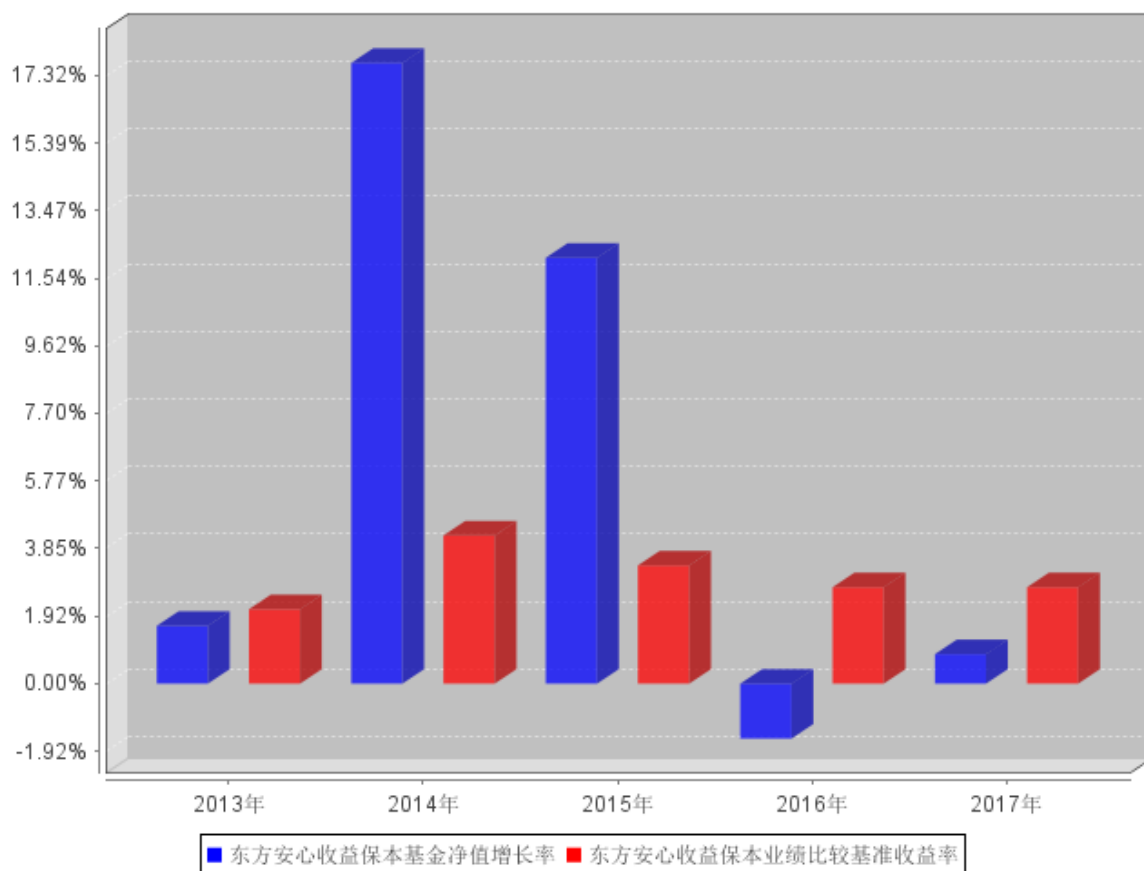
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方安心收益保本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



### 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

东方安心收益保本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对比图



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<br>分红数 | 现金形式发放<br>总额  | 再投资形式发<br>放总额 | 年度利润分配合<br>计  | 备注 |
|------|-----------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 2017 | -               | -             | -             | -             |    |
| 2016 | -               | -             | -             | -             |    |
| 2015 | 0.7000          | 77,161,761.94 | 0.62          | 77,161,762.56 |    |
| 合计   | 0.7000          | 77,161,761.94 | 0.62          | 77,161,762.56 |    |

## § 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 12 月 31 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 12 月 31 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

| 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 |        |                                       |
| 朱晓栋<br>(先生) | 本基金基金经理、权益投资部副总经理、投资决策委员 | 2014 年 1 月 30 日 | -    | 8 年    | 权益投资部副总经理，投资决策委员会委员，对外经济贸易大学经济学硕士，8 年 |

|  |            |  |  |  |
|--|------------|--|--|--|
|  | <p>会委员</p> |  |  | <p>证券从业经历。2009年12月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任研究部金融行业、固定收益研究、食品饮料行业、建筑建材行业研究员，东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方精选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。现任东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方新策</p> |
|--|------------|--|--|--|



|               |         |                 |   |     |   |
|---------------|---------|-----------------|---|-----|---|
|               |         |                 |   |     | 略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方区域发展混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理。  |
| 吴 萍 萍<br>(女士) | 本基金基金经理 | 2016 年 3 月 21 日 | - | 6 年 | 中国人民大学应用经济学硕士，6 年证券从业经历，曾任安信证券投资组资金交易员、民生加银基金管理有限公司专户投资经理。2015 年 11 月加盟东方基金管理有限公司，曾任东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理助理、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理助理、东方强化收益债券型证券投资基金基 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 金经理助理，<br>现任东方安心<br>收益保本混合<br>型证券投资基金<br>基金经理、<br>东方合家保本<br>混合型证券投资<br>基金基金经理、<br>东方永兴<br>18 个月定期<br>开放债券型证<br>券投资基金基<br>金经理、东方<br>臻悦纯债债券<br>型证券投资基<br>金基金经理、<br>东方添益债券<br>型证券投资基<br>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、《东方安心收益保本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

报告期内，本基金以行业生命周期为选股逻辑，结合对宏观环境和行业景气度的判断，对看好的行业与个股进行重点投资。

市场方面，呈现强者恒强，投资者持仓进一步集中的趋势，一线龙头白酒公司的业绩超预期带动整个消费板块领涨市场；随着金融去杠杆政策的延续，无风险利率进一步攀升，周期板块出现景气回落的状况，中小市值个股在 IPO 的持续压力之下，也出现明显调整，市场呈现两极分

化的态势。

报告期内，本基金持仓个股的估值出现较为明显的下降，而对于表现较好的蓝筹股，持仓比例较低，导致基金净值出现回撤。展望全年，我们认为在流动性紧平衡的格局之下，市场很难出现估值提升的趋势性行情，预计以沪深 300 为代表的蓝筹涨幅与全年业绩增长相当；而随着业绩的确定性逐步落地，前期由于情绪的打压导致超跌的优质成长股则将迎来较好的投资机会，有望出现估值与业绩双升的行情；

从基本面来看，2017 年宏观经济平稳回升，GDP 同比增长 6.9%。供给收缩、需求改善，PPI 与 CPI 的裂口持续扩大，支撑经济韧性。从政策面来看，金融去杠杆思路明确，流动性新规、资管新规意见稿等监管规则陆续出台，机构行为调整逐步开始。从资金面来看，货币政策稳健中性，公开市场操作削峰填谷，定向降准不改结构性货币短缺的供给体系。在海外货币政策收紧的背景下，央行一方面保证流动性总量均衡，另一方面上调公开市场政策利率 25BP，一定程度抬升了机构融资成本。

从债券市场来看，在基本面平稳回升、严监管持续推进、货币利率中枢抬升的背景下，2017 年债券收益率震荡上行，十年国开债较年初上行近 110BP，十年国债较年初上行近 80BP。较强的基本面制约了债券收益率下行，基本面的指引作用相对弱化，市场主要围绕流动性、监管政策展开博弈。报告期内，债市波动较大，本基金操作灵活，以谨慎防御策略为主，持仓主要以存单、高评级信用债为主，配合可转债打新以增厚收益，组合久期保持在中性偏短水平，并保持较低仓位，警惕流动性风险、信用风险，实现风险与收益的平衡。

本基金将积极对持仓结构进行优化，均衡组合配置，以为投资者提供更高的回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日，本基金净值增长率为 0.84%，业绩比较基准收益率为 2.75%，低于业绩比较基准 1.91%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在金融去杠杆与供给侧改革政策的共振之下，我们认为经济总体保持稳中略降的态势。从前 2 月的情况来看，出口是经济的亮点，但随着贸易战风险的上升，出口在下半年的不确定性也将更大。

对于市场的判断，在流动性紧平衡的状态下，很难出现估值提升的趋势性行情，市场总体赚业绩增长的钱；而随着部分优质成长股由于情绪的冲击，出现明显错杀，随着业绩的逐步确认，

有望迎来估值业绩双升的行情。

展望 2018 年，名义 GDP 拐点显现，国内经济或将温和回落，主因政策收紧及资金约束将成为地产、基建投资大幅增长的桎梏。从资金面角度来看，央行仍将通过 MLF、公开市场操作等货币工具紧密调控流动性投放，对冲财政收支、缴准以及其他季节性冲击，从而保证总量均衡。价格方面，在年内预期美联储加息 3 至 4 次的背景下，央行或将上调公开市场政策利率，并协同配合监管政策，保证温和去杠杆的目标。

对于 2018 年债券市场而言，短期持谨慎态度，主因基本面尚且平稳、金融监管政策并未出清、美联储加息扰动、货币政策稳健中性的基调尚未根本逆转。中长期来看，随着政府加强地方债务管理、持续推进国企去杠杆、规范居民贷款发放、严控非标融资等，融资需求将一定程度受到抑制，债券可期待基本面转弱后的机会。

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，定期和实时监控，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，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本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管业务，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领域的合法合规。(2) 根据中国证监会颁布的相关法律法规，进一步加强了基金投资监察力度，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《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金会计核算业务指

引》及相关会计核算业务细则，本管理人对所管理的基金各项资产进行核算，本报告期间没有需要披露的对基金估值有重大影响的估值程序调整等信息。现对本基金管理人估值程序说明如下：

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）。

#### **4.8 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。

#### **4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明**

-

#### **4.10 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《东方安心收益保本混合型证券投资基金基金合同》与《东方安心收益保本混合型证券投资基金托管协议》，自 2013 年 7 月 3 日起托管东方安心收益保本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。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 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

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                      |
|------------|----------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                    |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见              |
| 审计报告编号     | 信会师报字[2018]第 ZB30040 |

### 6.2 审计报告的基本内容

|           |   |
|-----------|---|
| 审计报告标题    | 审计报告  |
| 审计报告收件人   | 东方安心收益保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人  |
| 审计意见      | 我们审计了东方安心收益保本混合型证券投资基金(以下简称东方安心收益保本基金)财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。<br>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了东方安心收益保本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于东方安心收益保本基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。   |
| 其他信息      | 东方安心收益保本基金的基金管理人东方基金管理有限责任公司(以下简称基金管理人)对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。<br>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。<br>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的                |



|                        |   |
|------------------------|---|
|                        | <p>情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。<br/>         基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>  |
| <p>管理层和治理层对财务报表的责任</p> | <p>基金管理人负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。<br/>         在编制财务报表时，基金管理人负责评估东方安心收益保本基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>   |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。<br/>         在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对基金管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对东方安心收益保本基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披</p> |

|           |   |
|-----------|---|
|           | <p>露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致东方安心收益保本基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 立信会计师事务所（特殊普通合伙）  |
| 注册会计师的姓名  | 朱锦梅 赵立卿   |
| 会计师事务所的地址 | 北京市海淀区西四环中路 16 号院 7 号楼 10 层   |
| 审计报告日期    | 2018 年 3 月 28 日   |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东方安心收益保本混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |                         |                          |
| 银行存款       | 2,377,151.03            | 43,567,219.36            |
| 结算备付金      | 3,290,174.12            | 294,289.53               |
| 存出保证金      | 110,964.76              | 109,511.72               |
| 交易性金融资产    | 1,023,560,725.73        | 1,336,641,645.66         |
| 其中：股票投资    | 106,984,092.33          | 83,360,571.06            |
| 基金投资       | -                       | -                        |
| 债券投资       | 916,576,633.40          | 1,253,281,074.60         |
| 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   | 29,500,244.25           | 408,301,267.45           |
| 应收证券清算款    | -                       | 19,240.49                |
| 应收利息       | 16,198,828.72           | 35,598,929.81            |

|                 |                    |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 应收股利            | -                  | -                  |
| 应收申购款           | 4,852.28           | 396.91             |
| 递延所得税资产         | -                  | -                  |
| 其他资产            | -                  | -                  |
| 资产总计            | 1,075,042,940.89   | 1,824,532,500.93   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b>         | <b>上年度末</b>        |
|                 | <b>2017年12月31日</b> | <b>2016年12月31日</b> |
| <b>负 债:</b>     |                    |                    |
| 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       | -                  | 19,999,850.00      |
| 应付证券清算款         | -                  | 18,005,899.58      |
| 应付赎回款           | 897,995.29         | 218,487.82         |
| 应付管理人报酬         | 1,187,558.14       | 1,993,944.89       |
| 应付托管费           | 182,701.28         | 306,760.77         |
| 应付销售服务费         | -                  | -                  |
| 应付交易费用          | 1,643,151.72       | 1,445,067.83       |
| 应交税费            | -                  | -                  |
| 应付利息            | -                  | 3,895.62           |
| 应付利润            | -                  | -                  |
| 递延所得税负债         | -                  | -                  |
| 其他负债            | 341,677.91         | 190,305.31         |
| 负债合计            | 4,253,084.34       | 42,164,211.82      |
| <b>所有者权益:</b>   |                    |                    |
| 实收基金            | 848,619,085.43     | 1,424,521,741.74   |
| 未分配利润           | 222,170,771.12     | 357,846,547.37     |
| 所有者权益合计         | 1,070,789,856.55   | 1,782,368,289.11   |
| 负债和所有者权益总计      | 1,075,042,940.89   | 1,824,532,500.93   |

注:报告截止日 2017 年 12 月 31 日,基金份额净值 0.9843 元,基金份额总额 1,087,835,809.87 份。

## 7.2 利润表

会计主体: 东方安心收益保本混合型证券投资基金

本报告期: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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 12 月 31 日 | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |
| 一、收入 | 31,647,659.37                    | -16,956,497.02                   |

|                            |                      |                       |
|----------------------------|----------------------|-----------------------|
| 1. 利息收入                    | 56,936,374.38        | 56,423,977.58         |
| 其中：存款利息收入                  | 947,702.82           | 3,048,627.54          |
| 债券利息收入                     | 48,849,980.02        | 50,244,920.97         |
| 资产支持证券利息收入                 | 159,000.00           | -                     |
| 买入返售金融资产收入                 | 6,979,691.54         | 3,130,429.07          |
| 其他利息收入                     | -                    | -                     |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          | -41,719,443.36       | -33,795,758.18        |
| 其中：股票投资收益                  | 5,152,925.58         | 8,724,296.15          |
| 基金投资收益                     | -                    | -                     |
| 债券投资收益                     | -47,913,602.04       | -42,649,966.74        |
| 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                       | 1,041,233.10         | 129,912.41            |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 15,902,733.07        | -40,677,282.35        |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         | -                    | -                     |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 527,995.28           | 1,092,565.93          |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>20,779,966.95</b> | <b>21,380,272.89</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 16,367,675.15        | 16,940,727.97         |
| 2. 托管费                     | 2,518,103.86         | 2,606,265.87          |
| 3. 销售服务费                   | -                    | -                     |
| 4. 交易费用                    | 400,478.13           | 442,248.75            |
| 5. 利息支出                    | 1,216,309.81         | 1,172,630.30          |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 1,216,309.81         | 1,172,630.30          |
| 6. 其他费用                    | 277,400.00           | 218,400.00            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>10,867,692.42</b> | <b>-38,336,769.91</b> |
| 减：所得税费用                    | -                    | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>10,867,692.42</b> | <b>-38,336,769.91</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东方安心收益保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期                               |
|----|----------------------------------|
|    | 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）                        | 1,424,521,741.74                 | 357,846,547.37  | 1,782,368,289.11 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -                                | 10,867,692.42   | 10,867,692.42    |
| 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）      | -575,902,656.31                  | -146,543,468.67 | -722,446,124.98  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,128,977.31                     | 290,908.24      | 1,419,885.55     |
| 2. 基金赎回款                               | -577,031,633.62                  | -146,834,376.91 | -723,866,010.53  |
| 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）                        | 848,619,085.43                   | 222,170,771.12  | 1,070,789,856.55 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016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）                        | 1,101,047,262.81                 | 298,491,273.94  | 1,399,538,536.75 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -                                | -38,336,769.91  | -38,336,769.91   |
| 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）      | 323,474,478.93                   | 97,692,043.34   | 421,166,522.27   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 914,221,018.66                   | 257,397,907.06  | 1,171,618,925.72 |
| 2. 基金赎回款                               | -590,746,539.73                  | -159,705,863.72 | -750,452,403.45  |
| 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）                        | 1,424,521,741.74                 | 357,846,547.37  | 1,782,368,289.11 |

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：

---

刘鸿鹏

基金管理人负责人

---

刘鸿鹏

主管会计工作负责人

---

肖向辉

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

东方安心收益保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2013 年 4 月 19 日中国证监会《关于核准东方安心收益保本混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]368 号）和《关于东方安心收益保本混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2013]296 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《东方安心收益保本混合型证券投资基金基金合同》自 2013 年 5 月 13 日至 2013 年 6 月 28 日公开募集设立。本基金为混合型开放式证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 221,279,645.45 元人民币，业经立信会计师事务所（特殊普通合伙）“信会师报字[2013]第 230037 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东方安心收益保本混合型证券投资基金基金合同》于 2013 年 7 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 221,496,054.75 份基金单位，其中认购资金利息折合 216,409.30 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《东方安心收益保本混合型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，主要投资于固定收益类金融工具，包括国债、中央银行票据、地方政府债、金融债（含政策性金融债）、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债）、次级债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金也可以参与新股申购、增发股票申购、要约收购类股票投资、持有可转换债券转股所得的股票、投资二级市场股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）以及权证等中国证监会允许基金投资的其它权益类金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 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、会计估计与最近一期年度报告保持一致。

### 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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施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《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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《财政部、国家税务总局关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税，存款利息收入不征收增值税。

根据规定，基金产品运营过程中发生的增值税应税行为，以基金产品管理人为增值税纳税人。

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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 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、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

5、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、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

### 7.4.7 关联方关系

| 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        |
| 渤海国际信托股份有限公司    | 本基金管理人股东           |
| 河北省国有资产控股运营有限公司 | 本基金管理人股东           |
| 东方汇智资产管理有限公司    | 本基金管理人下属子公司        |

### 7.4.8 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。

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易



金额单位：人民币元

| 关联方名称          | 本期<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |                      | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |                      |
|----------------|-----------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|
|                | 成交金额                        | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                             | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 |
| 东北证券股份<br>有限公司 | 253,668,458.94              | 100.00%              | 258,291,931.61                   | 100.00%              |

#### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称          | 本期<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |                      | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |                      |
|----------------|-----------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|
|                | 成交金额                        | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                             | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 |
| 东北证券股份<br>有限公司 | 463,562,316.68              | 100.00%              | 356,710,593.93                   | 100.00%              |

#### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称          | 本期<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |                            | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |                            |
|----------------|-----------------------------|----------------------------|----------------------------------|----------------------------|
|                | 回购成交金额                      | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 | 回购成交金额                           | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 |
| 东北证券股份<br>有限公司 | 1,281,700,000.00            | 100.00%                    | 442,700,000.00                   | 100.00%                    |

#### 7.4.8.1.4 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。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |
|-------|-----------------------------|
|       |                             |

|                | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金<br>总量的比例        | 期末应付佣金余额     | 占期末应付佣<br>金总额的比例        |
|----------------|----------------------------------|-----------------------|--------------|-------------------------|
| 东北证券股份<br>有限公司 | 234,243.79                       | 100.00%               | 1,635,183.89 | 100.00%                 |
| 关联方名称          | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |                       |              |                         |
|                | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金<br>总量的比例<br>(%) | 期末应付佣金余额     | 占期末应付佣<br>金总额的比例<br>(%) |
| 东北证券股份<br>有限公司 | 237,562.45                       | 100.00%               | 1,400,940.10 | 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。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

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12月31日 | 2016年1月1日至2016年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 16,367,675.15         | 16,940,727.97         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,537,222.71          | 1,964,376.43          |

注：①计提标准：本基金的管理费每日按前一日基金资产净值的 1.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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前五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。

##### 7.4.8.2.2 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 12 月 31 日 | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,518,103.86                     | 2,606,265.87                     |

注：①计提标准：本基金的托管费每日按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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前五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。

### 7.4.8.3 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<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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                              | -      | -    | -     | -    | 23,000,000.00 | 8,771.51 |

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 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<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |
|----|--|---|
|    | 基金合同生效日（2013 年 7 月 3 日）持有的基金份额         | -   |

|                   |               |               |
|-------------------|---------------|---------------|
| 期初持有的基金份额         | 10,497,510.81 | 8,189,189.18  |
| 期间申购/买入总份额        | -             | -             |
| 期间因拆分变动份额         | -             | 2,308,321.63  |
| 减：期间赎回/卖出总份额      | 10,497,510.81 | -             |
| 期末持有的基金份额         | 0.00          | 10,497,510.81 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.00%         | 0.57%         |

注：根据《东方安心收益保本混合型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。基金管理人运用固有资金投资本基金适用的申购费用为 1000 元/笔。根据《东方安心收益保本混合型证券投资基金招募说明书》中对赎回费用的规定，持有期限 2 年以上（含 2 年）无赎回费。

#### 7.4.8.4.2 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。

#### 7.4.8.5 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<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |           | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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 | 2,377,151.03                           | 94,614.06 | 43,567,219.36                               | 1,683,918.11 |

#### 7.4.8.6 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。

### 7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.9.1 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。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期        | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期      | 复牌开盘单价 | 数量(股)   | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|-------------|------|--------|-----------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 000971 | 高升控股 | 2017年10月16日 | 重大事项 | 14.41  | 2018年1月9日 | 16.89  | 400,000 | 9,351,824.00 | 5,764,000.00 | -  |
| 300730 | 科创信息 | 2017年12月25日 | 临时停牌 | 41.55  | 2018年1月2日 | 45.71  | 821     | 6,863.56     | 34,112.55    | -  |
| 002919 | 名臣健康 | 2017年12月28日 | 临时停牌 | 35.26  | 2018年1月2日 | 38.79  | 821     | 10,311.76    | 28,948.46    | -  |

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 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。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 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。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止本年度报告报出日, 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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 | 106,984,092.33 | 9.95          |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 其中：股票             | 106,984,092.33   | 9.95   |
| 2 | 基金投资              | -                | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 916,576,633.40   | 85.26  |
|   | 其中：债券             | 916,576,633.40   | 85.26  |
|   | 资产支持证券            | -                | -      |
| 4 | 贵金属投资             | -                | -      |
| 5 | 金融衍生品投资           | -                | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | 29,500,244.25    | 2.74   |
|   | 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      | 5,667,325.15     | 0.53   |
| 8 | 其他各项资产            | 16,314,645.76    | 1.52   |
| 9 | 合计                | 1,075,042,940.89 | 100.00 |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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              | 58,351,021.40 | 5.45          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,195,000.00 | 1.14          |
| E  | 建筑业              | -             | -             |
| F  | 批发和零售业           | -             | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -             |
| H  | 住宿和餐饮业           | 16,184,458.38 | 1.51          |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 11,758,612.55 | 1.10          |
| J  | 金融业              | 8,495,000.00  | 0.79          |
| K  | 房地产业             | -             | -             |
| 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        | 106,984,092.33 | 9.99 |

### 8.3 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

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  | 000959 | 首钢股份 | 3,899,937 | 23,321,623.26 | 2.18         |
| 2  | 600754 | 锦江股份 | 501,222   | 16,184,458.38 | 1.51         |
| 3  | 002531 | 天顺风能 | 1,799,916 | 14,579,319.60 | 1.36         |
| 4  | 600681 | 百川能源 | 900,000   | 12,195,000.00 | 1.14         |
| 5  | 002481 | 双塔食品 | 1,700,000 | 8,704,000.00  | 0.81         |
| 6  | 601166 | 兴业银行 | 500,000   | 8,495,000.00  | 0.79         |
| 7  | 603839 | 安正时尚 | 260,000   | 6,370,000.00  | 0.59         |
| 8  | 600804 | 鹏博士  | 350,000   | 5,960,500.00  | 0.56         |
| 9  | 000971 | 高升控股 | 400,000   | 5,764,000.00  | 0.54         |
| 10 | 600500 | 中化国际 | 600,000   | 5,076,000.00  | 0.47         |

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。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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  | 000959 | 首钢股份 | 18,551,306.40 | 1.04           |
| 2  | 600681 | 百川能源 | 14,379,277.00 | 0.81           |
| 3  | 300401 | 花园生物 | 13,704,559.39 | 0.77           |
| 4  | 002531 | 天顺风能 | 11,899,151.68 | 0.67           |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 8,879,826.00  | 0.50           |
| 6  | 600498 | 烽火通信 | 7,727,638.00  | 0.43           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 7  | 600804 | 鹏博士  | 7,378,620.00 | 0.41 |
| 8  | 600525 | 长园集团 | 7,349,942.20 | 0.41 |
| 9  | 600500 | 中化国际 | 6,250,760.96 | 0.35 |
| 10 | 002481 | 双塔食品 | 6,153,750.00 | 0.35 |
| 11 | 603839 | 安正时尚 | 5,998,914.20 | 0.34 |
| 12 | 600612 | 老凤祥  | 5,992,576.93 | 0.34 |
| 13 | 601336 | 新华保险 | 5,848,368.21 | 0.33 |
| 14 | 600036 | 招商银行 | 5,120,723.00 | 0.29 |
| 15 | 000567 | 海德股份 | 4,690,099.00 | 0.26 |
| 16 | 000971 | 高升控股 | 4,329,948.00 | 0.24 |
| 17 | 600268 | 国电南自 | 4,201,043.45 | 0.24 |
| 18 | 600025 | 华能水电 | 205,527.21   | 0.01 |
| 19 | 601019 | 山东出版 | 128,320.80   | 0.01 |
| 20 | 002920 | 德赛西威 | 93,298.98    | 0.01 |

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。

#### 8.4.2 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  | 300401 | 花园生物 | 27,467,964.00 | 1.54           |
| 2  | 600498 | 烽火通信 | 8,762,782.00  | 0.49           |
| 3  | 600919 | 江苏银行 | 7,525,600.00  | 0.42           |
| 4  | 600525 | 长园集团 | 7,412,149.40  | 0.42           |
| 5  | 600612 | 老凤祥  | 7,193,489.00  | 0.40           |
| 6  | 601336 | 新华保险 | 6,191,058.00  | 0.35           |
| 7  | 601988 | 中国银行 | 5,718,560.00  | 0.32           |
| 8  | 600036 | 招商银行 | 5,539,489.00  | 0.31           |
| 9  | 000567 | 海德股份 | 5,217,129.00  | 0.29           |
| 10 | 601818 | 光大银行 | 4,855,200.00  | 0.27           |
| 11 | 600754 | 锦江股份 | 4,559,093.00  | 0.26           |
| 12 | 002063 | 远光软件 | 4,196,071.00  | 0.24           |
| 13 | 600666 | 奥瑞德  | 4,062,353.00  | 0.23           |
| 14 | 600549 | 厦门钨业 | 3,966,194.00  | 0.22           |
| 15 | 600259 | 广晟有色 | 3,816,259.00  | 0.21           |



|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 16 | 600268 | 国电南自 | 2,805,974.00 | 0.16 |
| 17 | 300429 | 强力新材 | 2,377,721.00 | 0.13 |
| 18 | 600025 | 华能水电 | 509,555.94   | 0.03 |
| 19 | 601375 | 中原证券 | 236,784.65   | 0.01 |
| 20 | 601019 | 山东出版 | 204,606.00   | 0.01 |

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。

### 8.4.3 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 | 139,768,642.95 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 115,211,954.52 |

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。

### 8.5 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      | 59,866,000.00  | 5.59         |
|    | 其中：政策性金融债 | 59,866,000.00  | 5.59         |
| 4  | 企业债券      | 162,437,425.40 | 15.17        |
| 5  | 企业短期融资券   | 69,985,000.00  | 6.54         |
| 6  | 中期票据      | 576,062,000.00 | 53.80        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 692,208.00     | 0.06         |
| 8  | 同业存单      | 47,534,000.00  | 4.44         |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 916,576,633.40 | 85.60        |

## 8.6 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

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  | 101456044 | 14 渝富 MTN001        | 500,000 | 50,880,000.00 | 4.75         |
| 2  | 101575002 | 15 沪城控 MTN001（3 年期） | 500,000 | 50,165,000.00 | 4.68         |
| 3  | 0980165   | 09 铁道 09            | 500,000 | 49,570,000.00 | 4.63         |
| 4  | 101653043 | 16 九龙仓 MTN001       | 500,000 | 47,920,000.00 | 4.48         |
| 5  | 101554044 | 15 首开股份 MTN001      | 400,000 | 40,032,000.00 | 3.74         |

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 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。

## 8.11 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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   | 110,964.76    |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 16,198,828.72 |
| 5  | 应收申购款   | 4,852.28      |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 16,314,645.76 |

### 8.12.4 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可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值  | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|---------------|----------|
| 1  | 000971 | 高升控股 | 5,764,000.00 | 0.54          | 重大事项     |

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 7,884        | 137,980.19    | 496,793,773.65 | 45.67%     | 591,042,036.22 | 54.33%     |

### 9.3 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 | 0         | 0        |

### 9.4 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                 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                          |                  |
|--------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2013年7月3日）基金份额总额 | 221,496,054.75   |
| 本报告期期初基金份额总额             | 1,826,058,528.41 |
| 本报告期基金总申购份额              | 1,447,210.74     |
| 减:本报告期基金总赎回份额            | 739,669,929.28   |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                |

|             |                  |
|-------------|------------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 1,087,835,809.87 |
|-------------|------------------|

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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，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。

### 11.3 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基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度应支付给立信会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 40000 元；截至 2017 年 12 月 31 日，该审计机构已向本基金提供 5 年的审计服务。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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 |    | 2,253,668,458.94 | 100.00%      | 234,243.79 | 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。

**11.7.2 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 | 463,562,316.68 | 100.00%      | 1,281,700,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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              | 2017-1-1 至 2017-2-23    | 419,032,722.93 | -    | 419,032,722.93 | 0.00           | 0.00%  |
|  | 2              | 2017-2-24 至 2017-12-31  | 298,966,800.66 | -    | -              | 298,966,800.66 | 27.48% |
| 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  
2018 年 3 月 31 日