

---

# 东方安心收益保本混合型证券投资基金 2018 年年度报告

2018 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：二〇一九年三月二十八日

## § 1 重要提示及目录

### 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 2019 年 3 月 26 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 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b> .....                             | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....  | 2         |
| 1.2 目录.....  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b> .....                                | <b>8</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                                      | 8         |
| 2.2 基金产品说明.....                                      | 8         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                                 | 8         |
| 2.4 信息披露方式.....                                      | 9         |
| 2.5 其他相关资料.....                                      | 9         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....                | <b>10</b> |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                                 | 10        |
| 3.2 基金净值表现.....                                      | 10        |
| 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.....                | 10        |
| 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..... | 11        |
| 3.2.3 过去五年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.....            | 12        |
| 3.3 其他指标.....  | 12        |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况.....                               | 12        |
| <b>§ 4 管理人报告</b> .....                               | <b>13</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                                | 13        |
| 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验.....                            | 13        |
| 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介.....                    | 13        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....                      | 16        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                         | 16        |
| 4.3.1 公平交易制度和控制方法.....                               | 16        |
| 4.3.2 公平交易制度的执行情况.....                               | 16        |
| 4.3.3 异常交易行为的专项说明.....                               | 17        |
| 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.....                     | 17        |
| 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析.....                           | 17        |
| 4.4.2 报告期内基金的业绩表现.....                               | 17        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....                     | 17        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                         | 18        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                        | 19        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                         | 20        |
| 4.9 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.....               | 20        |
| <b>§ 5 托管人报告</b> .....                               | <b>21</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                          | 21        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....         | 21        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....               | 21        |
| <b>§ 6 审计报告</b> .....                                | <b>22</b> |
| 6.1 审计报告基本信息.....                                    | 22        |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                                   | 22        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b> .....                              | <b>25</b> |

|                                       |                  |
|---------------------------------------|------------------|
| 7.1 资产负债表.....                        | 25               |
| 7.2 利润表.....                          | 26               |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....               | 27               |
| 7.4 报表附注.....                         | 28               |
| 7.4.1 基金基本情况.....                     | 28               |
| 7.4.2 会计报表的编制基础.....                  | 29               |
| 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明.....         | 29               |
| 7.4.4 重要会计政策和会计估计.....                | 29               |
| 7.4.4.1 会计年度.....                     | 29               |
| 7.4.4.2 记账本位币.....                    | 29               |
| 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类.....             | 29               |
| 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认..... | 30               |
| 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则.....           | 32               |
| 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销.....             | 33               |
| 7.4.4.7 实收基金.....                     | 34               |
| 7.4.4.8 损益平准金.....                    | 34               |
| 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量.....            | 34               |
| 7.4.4.10 费用的确认和计量.....                | 35               |
| 7.4.4.11 基金的收益分配政策.....               | 35               |
| .....                                 | <b>错误!未定义书签。</b> |
| 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计.....          | 36               |
| 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明.....       | 36               |
| 7.4.5.1 会计政策变更的说明.....                | 36               |
| 7.4.5.2 会计估计变更的说明.....                | 36               |
| 7.4.5.3 差错更正的说明.....                  | 36               |
| 7.4.6 税项.....                         | 36               |
| 7.4.7 重要财务报表项目的说明.....                | 37               |
| 7.4.7.1 银行存款.....                     | 37               |
| 7.4.7.2 交易性金融资产.....                  | 38               |
| 7.4.7.3 衍生金融资产/负债.....                | 38               |
| 7.4.7.4 买入返售金融资产.....                 | 38               |
| 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额.....         | 38               |
| 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券.....       | 39               |
| 7.4.7.5 应收利息.....                     | 39               |
| 7.4.7.6 其他资产.....                     | 39               |
| 7.4.7.7 应付交易费用.....                   | 39               |
| 7.4.7.8 其他负债.....                     | 40               |
| 7.4.7.9 实收基金.....                     | 40               |
| 7.4.7.10 未分配利润.....                   | 40               |
| 7.4.7.11 存款利息收入.....                  | 40               |
| 7.4.7.12 股票投资收益.....                  | 41               |
| .....                                 | <b>错误!未定义书签。</b> |
| 7.4.7.13 债券投资收益.....                  | 41               |
| 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成.....            | 41               |
| 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入.....      | 41               |

删除了: 36

删除了: 41

|  |                  |    |
|--|------------------|----|
| .....                                      | <b>错误!未定义书签。</b> |    |
| .....                                      | <b>错误!未定义书签。</b> |    |
| 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益.....                 |                  | 42 |
| 7.4.7.14 贵金属投资收益.....                      |                  | 42 |
| 7.4.7.15 衍生工具收益.....                       |                  | 42 |
| 7.4.7.16 股利收益.....                         |                  | 42 |
| 7.4.7.17 公允价值变动收益.....                     |                  | 42 |
| 7.4.7.18 其他收入.....                         |                  | 43 |
| 7.4.7.19 交易费用.....                         |                  | 43 |
| 7.4.7.20 其他费用.....                         |                  | 43 |
| .....                                      | <b>错误!未定义书签。</b> |    |
| 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明.....               |                  | 44 |
| 7.4.8.1 或有事项.....                          |                  | 44 |
| 7.4.8.2 资产负债表日后事项.....                     |                  | 44 |
| 7.4.9 关联方关系.....                           |                  | 44 |
| 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易.....             |                  | 44 |
| 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易.....               |                  | 44 |
| 7.4.10.1.1 股票交易.....                       |                  | 44 |
| 7.4.10.1.2 债券交易.....                       |                  | 44 |
| 7.4.10.1.3 债券回购交易.....                     |                  | 45 |
| 7.4.10.1.4 权证交易.....                       |                  | 45 |
| 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金.....                  |                  | 45 |
| 7.4.10.2 关联方报酬.....                        |                  | 46 |
| 7.4.10.2.1 基金管理费.....                      |                  | 46 |
| 7.4.10.2.2 基金托管费.....                      |                  | 46 |
| .....                                      | <b>错误!未定义书签。</b> |    |
| 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易.....      |                  | 47 |
| 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况.....                 |                  | 47 |
| 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况.....    |                  | 47 |
| 7.4.10.4.2 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..... |                  | 47 |
| 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入.....      |                  | 47 |
| 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况.....         |                  | 47 |
| .....                                      | <b>错误!未定义书签。</b> |    |
| 7.4.11 利润分配情况.....                         |                  | 47 |
| 7.4.12 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券.....    |                  | 47 |
| 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券.....      |                  | 47 |
| 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票.....             |                  | 47 |
| 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券.....            |                  | 47 |
| 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购.....                 |                  | 47 |
| 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购.....                 |                  | 48 |
| 7.4.13 金融工具风险及管理.....                      |                  | 48 |
| 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构.....                  |                  | 48 |
| 7.4.13.2 信用风险.....                         |                  | 49 |

删除了: 42

删除了: 42

删除了: 44

删除了: 47

删除了: 47



|   |                  |
|---|------------------|
| <b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....              | <b>63</b>        |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....              | 63               |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....           | 63               |
| 9.3 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.....  | 63               |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....             | <b>64</b>        |
| <b>§ 11 重大事件揭示</b> .....                | <b>65</b>        |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 65               |
| 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.....   | 65               |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 65               |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                     | 65               |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 65               |
| 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.....      | 65               |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 65               |
| 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.....   | 65               |
| 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.....     | 66               |
| 11.8 其他重大事件.....                        | 66               |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....        | <b>69</b>        |
| 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..... | 69               |
| .....                                   | <b>错误!未定义书签。</b> |
| <b>§ 13 备查文件目录</b> .....                | <b>70</b>        |
| 13.1 备查文件目录.....                        | 70               |
| 13.2 存放地点.....                          | 70               |
| 13.3 查阅方式.....                          | 70               |

删除了: 65  
 删除了: 65  
 删除了: 65  
 删除了: 65  
 删除了: 66  
 删除了: 67  
 删除了: 68  
 删除了: 68  
 删除了: 71  
 删除了: 71  
 删除了: 71  
 删除了: 72  
 删除了: 72  
 删除了: 72  
 删除了: 72

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 基金名称       | 东方安心收益保本混合型证券投资基金 |
| 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 | 674,407,729.23 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         |
| 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     | 张学文    |

## 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》  |  |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.orient-fund.com<br>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  |  |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称               | 办公地址                      |
|--------|------------------|---------------------------|
| 会计师事务所 | 立信会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市南京路61号新黄浦金融大厦4层        |
| 注册登记机构 | 东方基金管理有限责任公司     | 北京市西城区锦什坊街28号1-4层         |
| 基金保证人  | 深圳市高新投集团有限公司     | 深圳市深南大道7028号时代科技大厦22层、23层 |

### § 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 | 2018 年         | 2017 年           | 2016 年           |
|---------------|----------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益       | -5,811,274.82  | -5,035,040.65    | 2,340,512.44     |
| 本期利润          | 17,135,852.04  | 10,867,692.42    | -38,336,769.91   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0208         | 0.0085           | -0.0305          |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.10%          | 0.87%            | -2.79%           |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.36%          | 0.84%            | -1.56%           |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018 年末        | 2017 年末          | 2016 年末          |
| 期末可供分配利润      | 91,896,528.24  | 154,244,327.08   | 262,019,471.00   |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1363         | 0.1418           | 0.1435           |
| 期末基金资产净值      | 679,468,027.69 | 1,070,789,856.55 | 1,782,368,289.11 |
| 期末基金份额净值      | 1.0075         | 0.9843           | 0.9761           |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2018 年末        | 2017 年末          | 2016 年末          |
| 基金份额累计净值增长率   | 36.29%         | 33.15%           | 32.04%           |

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。

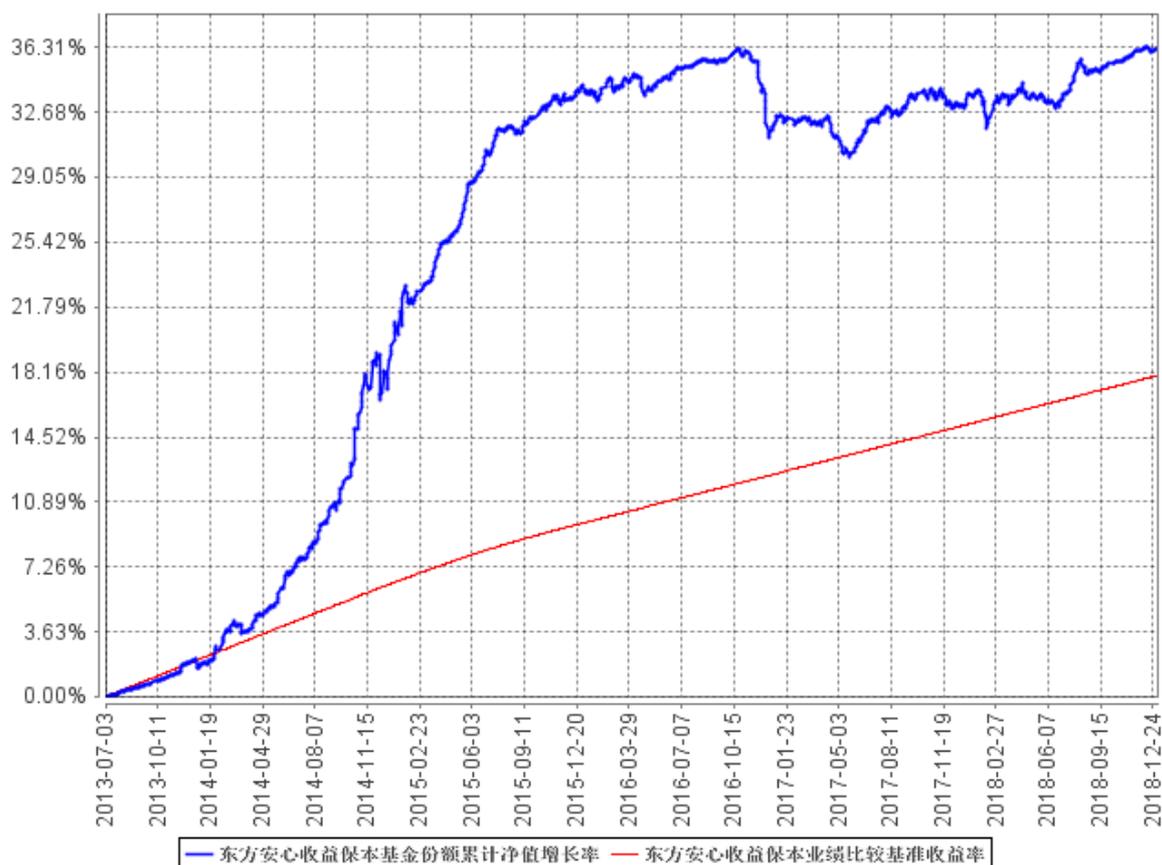
#### 3.2 基金净值表现

##### 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      | 0.64%    | 0.03%       | 0.69%      | 0.01%         | -0.05% | 0.02% |
| 过去六个月      | 2.24%    | 0.05%       | 1.39%      | 0.01%         | 0.85%  | 0.04% |
| 过去一年       | 2.36%    | 0.10%       | 2.75%      | 0.01%         | -0.39% | 0.09% |
| 过去三年       | 1.61%    | 0.10%       | 8.25%      | 0.01%         | -6.64% | 0.09% |
| 过去五年       | 34.07%   | 0.14%       | 15.84%     | 0.01%         | 18.23% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 36.29%   | 0.14%       | 17.96%     | 0.01%         | 18.33% | 0.13% |

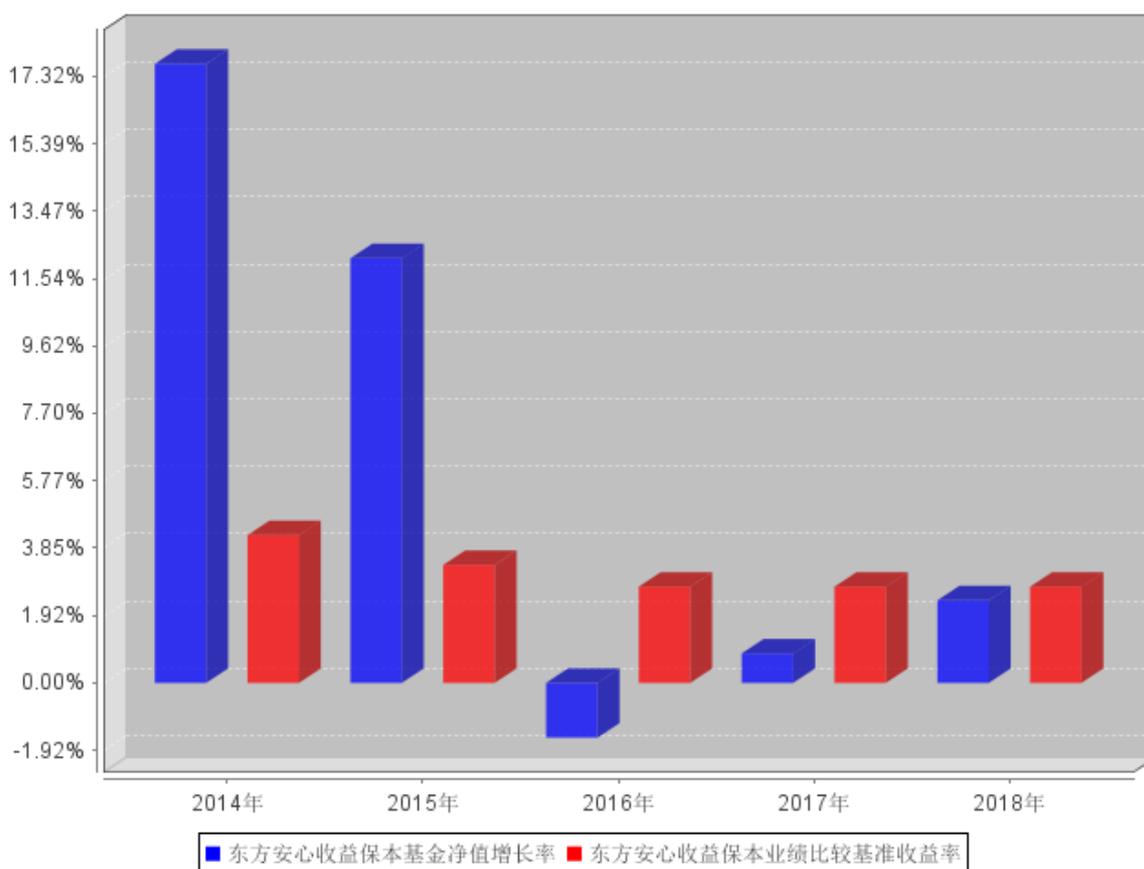
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 过去五年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

东方安心收益保本过去五年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



### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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2018年12月31日，本公司注册资本3亿元人民币。本公司股东东北证券股份有限公司出资人民币19200万元，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8100万元，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2700万元，占公司注册资本的9%。截止2018年12月31日，本公司管理40只开放式证券投资基金——东方安心收益保本混合型证券投资基金、东方策略成长混合型开放式证券投资基金、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金、东方创新科技混合型证券投资基金、东方大健康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、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金、东方核心动力混合型证券投资基金、东方互联网嘉混合型证券投资基金、东方惠新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、东方金元宝货币市场基金、东方金账簿货币市场证券投资基金、东方金证通货币市场基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方龙混合型开放式证券投资基金、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金、东方区域发展混合型证券投资基金、东方人工智能主题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、东方盛世灵活配置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、东方稳健回报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、东方新价值混合型证券投资基金、东方新能源汽车主题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、东方新兴成长混合型证券投资基金、东方永熙18个月定期开放债券型证券投资基金、东方永兴18个月定期开放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、东方臻宝纯债债券型证券投资基金、东方臻享纯债债券型证券投资基金、东方臻选纯债债券型证券投资基金、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金、东方周期优选灵活配置混合型证券投资基金、东方主题精选混合型证券投资基金。

#### 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 |        |                                 |
| 吴萍萍<br>(女士) | 本基金基金经理 | 2016年3月21日      | -    | 7年     | 中国人民大学应用经济学硕士，7年证券从业经历，曾任安信证券投资 |

|        |         |                |   |     |  |
|--------|---------|----------------|---|-----|--|
|        |         |                |   |     | <p>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责任公司，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、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方臻悦纯债债券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，现任东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方臻选纯债债券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。</p> |
| 李瑞（先生） | 本基金基金经理 | 2018 年 7 月 2 日 | - | 7 年 | <p>中国人民大学金融学硕士，7 年证券从业经历。2011 年 7 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任权益投资部研究员，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（于 2018 年 6 月 21 日起转型为东方新能源汽车主题混合型证券投资基金）基金经理，现任东方新能源汽车主题混合型证券投资基金基金经理、东方安心收</p>  |

|             |                   |            |           |    |  |
|-------------|-------------------|------------|-----------|----|--|
|             |                   |            |           |    | 益保本混合型证券投资基金基金经理、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。   |
| 朱晓栋<br>(先生) | 本基金基金经理、权益投资部副总经理 | 2014年1月30日 | 2018年7月2日 | 9年 | 权益投资部副总经理，对外经济贸易大学经济学硕士，9年证券从业经历。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，投资决策委员会委员，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日转型为东方核心动力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、东方安心收益保本混合型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、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理，现任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、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |

注：①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作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中的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；对于银行间交易，按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

### 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

2018 年市场内外环境复杂。2016 年开始的国内经济繁荣，包含了国内外多重因素的原因，尤其 2017 年，地产销售、基建、出口、消费均表现出了较好的增长。2018 年的情况相反，由于去杠杆和贸易战，这几项均面临较大挑战，尤其是地产销售和基建都比 2017 年减速，对经济的支撑作用会消退。货币政策方面，国内又面临货币向信用传导不畅的问题。

在企业微观层面，从 2016 年 2 季度开始的 ROE 上升的韧性还保持着惯性，究其原因，一方面，行业集中度提升和产业结构优化带来的龙头效应推动整体净利润率抬升，这是最重要的原因，另一方面，资产周转率也有所提升。但是后续随着宏观环境的影响，ROE 下行会滞后体现出来，只有增长质量和确定性高、持续性强的品种才能抵抗市场的风险。

基金操作策略上，一方面总体维持了较低的权益仓位水平，另一方面减持了高弹性标的，增持了竞争优势突出、盈利能力及质量优异的稳健标的。

2018 年基本面下行兑现、宽货币带动流动性持续宽松、风险资产下挫带动避险情绪回升，10 年国债、国开债收益率分别较年初下行 65BP、下行 118BP。信用市场方面，宽信用政策与民企违约交织，中高评级信用利差高位回落，低等级信用利差仍处高位。报告期内，本基金在做好流动性管理的同时，根据市场变化适当拉长久期、增加杠杆，持仓主要为高评级信用债，警惕流动性风险、信用风险，实现风险与收益的平衡。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日，本基金净值增长率为 2.36%，业绩比较基准收益率为 2.75%，低于业绩比较基准 0.39%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年市场担心的悬而未决的问题，比如经济增长新动力在哪，转型升级之路是否顺利，制度改革的决心和力度如何，投资者信心、企业信心如何恢复，这一系列问题的答案在民企座谈会、减税降费、资本市场改革和社会融资数据出现企稳迹象后，逐步开始被市场认识和认可。

经过 2018 年的单边下行，2019 年的市场会呈现机会多、波动大的特点。市场具体的走势需

要衡量分子和分母的赛跑，一方面关注优质资产基本面的抗波动能力和长期竞争力，经过 2018 年的洗礼，真正有核心竞争力的企业会体现出自己的抗风险能力，优势企业与劣势企业之间的分化不断扩大；另一方面关注政策托底带来的分母端的逐渐变化。

操作策略上，本基金将坚持长期优质标的的核心持仓。出于控制回撤的风险控制考虑，低仓位投资于安全边际高，质量优异的优质权益资产。未来仍将维持较低的权益仓位，严格控制标的的质量。

对于 2019 年债券市场而言，基本面下行、宽货币的逻辑仍支撑利率下行，在央行不下调政策利率的情形下，利率下行已步入后半程；债市的主要风险来自于稳增长的持续推进、信贷资金的持续放量、风险资产反弹带动市场偏好提升。对于信用市场而言，宽信用政策持续推进、CRMW 发行提速，融资关系改善，市场风险偏好有所回升，信用利差已见高点，预计未来阶段性收窄。分品种来看，宽财政背景下城投债性价比被动抬升；上游让渡下游的背景下，过剩产能债性价比下降；地产债宏观属性较强，利差仍有压缩空间；民企债的绝对收益具有吸引力，但风险事件处理效率一般、过度依赖直接融资，坚持自下而上，优选行业龙头且财务优质的主体，谨慎博弈资质下沉。

未来，本基金将继续以持有静态收益高、久期中性的信用债为主，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；因特殊情况，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 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

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在东方安心收益保本混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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[2019]第 ZB30043 号 |

### 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            | <p>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 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 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。</p> <p>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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>   |
| 形成审计意见的基础       | <p>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。</p>   |
| 其他信息            | <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>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> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <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。</p> <p>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（如适用），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。</p> <p>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              | 高慧丽 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市南京东路 61 号 4 楼 |     |
| 审计报告日期    | 2019 年 3 月 26 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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 1,064,136.83                    | 2,377,151.03                     |
| 结算备付金           |            | 16,863,672.96                   | 3,290,174.12                     |
| 存出保证金           |            | 171,870.63                      | 110,964.76                       |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 1,090,717,863.90                | 1,023,560,725.73                 |
| 其中：股票投资         |            | 303,000.00                      | 106,984,092.33                   |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 1,090,414,863.90                | 916,576,633.40                   |
| 资产支持证券投资        |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                               | 29,500,244.25                    |
| 应收证券清算款         |            | 99,990.39                       | -                                |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 20,635,019.40                   | 16,198,828.72                    |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 2,975.34                        | 4,852.28                         |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 1,129,555,529.45                | 1,075,042,940.89                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2017 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          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 447,763,045.30                  | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款           |            | 600,767.84                      | 897,995.29                       |
| 应付管理人报酬         |            | 755,872.30                      | 1,187,558.14                     |
| 应付托管费           |            | 116,288.03                      | 182,701.28                       |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 231,871.57                      | 1,643,151.72                     |
| 应交税费            |            | 124,450.69                      | -                                |
| 应付利息            |            | 106,206.03                      | -                                |

|               |          |                  |                  |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付利润          |          | -                | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 389,000.00       | 341,677.91       |
| 负债合计          |          | 450,087,501.76   | 4,253,084.34     |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 526,096,006.51   | 848,619,085.43   |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 153,372,021.18   | 222,170,771.12   |
| 所有者权益合计       |          | 679,468,027.69   | 1,070,789,856.55 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 1,129,555,529.45 | 1,075,042,940.89 |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0075 元，基金份额总额 674,407,729.23 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期                                  | 上年度可比期间                             |
|------------------------|------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|                        |            | 2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 12 月 31 日 | 2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 12 月 31 日 |
| <b>一、收入</b>            |            | 39,868,366.40                       | 31,647,659.37                       |
| 1. 利息收入                |            | 46,180,017.21                       | 56,936,374.38                       |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 288,603.77                          | 947,702.82                          |
| 债券利息收入                 |            | 45,796,893.13                       | 48,849,980.02                       |
| 资产支持证券利息收入             |            | -                                   | 159,000.00                          |
| 买入返售金融资产收入             |            | 94,520.31                           | 6,979,691.54                        |
| 其他利息收入                 |            | -                                   | -                                   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -29,306,531.87                      | -41,719,443.36                      |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | -28,654,250.44                      | 5,152,925.58                        |
| 基金投资收益                 |            | -                                   | -                                   |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.13   | -731,598.88                         | -47,913,602.04                      |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.13.3 | -                                   | -                                   |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.14   | -                                   | -                                   |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.15   | -                                   | -                                   |
| 股利收益                   | 7.4.7.16   | 79,317.45                           | 1,041,233.10                        |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17   | 22,947,126.86                       | 15,902,733.07                       |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                   | -                                   |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.18   | 47,754.20                           | 527,995.28                          |
| <b>减：二、费用</b>          |            | 22,732,514.36                       | 20,779,966.95                       |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 10,625,561.48                       | 16,367,675.15                       |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 1,634,701.70                        | 2,518,103.86                        |
| 3. 销售服务费               | 7.4.10.2.3 | -                                   | -                                   |

|                            |          |               |               |
|----------------------------|----------|---------------|---------------|
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19 | 434,924.53    | 400,478.13    |
| 5. 利息支出                    |          | 9,555,993.03  | 1,216,309.81  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 9,555,993.03  | 1,216,309.81  |
| 6. 税金及附加                   |          | 155,133.62    | -             |
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.20 | 326,200.00    | 277,400.00    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | 17,135,852.04 | 10,867,692.42 |
| 减：所得税费用                    |          | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | 17,135,852.04 | 10,867,692.42 |

### 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 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）                        | 848,619,085.43                              | 222,170,771.12 | 1,070,789,856.55 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 17,135,852.04  | 17,135,852.04    |
| 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）      | -322,523,078.92                             | -85,934,601.98 | -408,457,680.90  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,121,209.89                                | 308,463.14     | 1,429,673.03     |
| 2. 基金赎回款                               | -323,644,288.81                             | -86,243,065.12 | -409,887,353.93  |
| 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）                        | 526,096,006.51                              | 153,372,021.18 | 679,468,027.69   |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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 |

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：

|            |            |            |
|------------|------------|------------|
| <u>刘鸿鹏</u> | <u>刘鸿鹏</u> | <u>王丹丹</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    |

## 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颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（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 XBRL 模板第 3 号—年度报告和半年度报告》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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 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。

##### 7.4.4.3 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。

### 7.4.4.4 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。

### 7.4.4.5 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 2017 年 9 月 5 日中国证监会发布的【2017】13 号文《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》内容：如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应对估值进行调整并确定公允价，如指数收益法。

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的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在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。

### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 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 1.30%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 0.20%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、同业存单及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。

#### 7.4.4.11 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，基金收益每年最多分配 6 次，每次收益分配最低比例不得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、本基金收益分配方式：（1）保本周期内：本基金采用现金分红方式进行收益分配，不接受红利再投资方式，但基金管理人可以根据有关规定更改本基金的分红方式；（2）转型后：本基金基金收益分配方式分两种，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；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即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、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份

额享受当次分红；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

### 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》、[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《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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣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、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

2、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以

2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

3、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。

4、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。

5、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。

6、基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7、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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 1,064,136.83            | 2,377,151.03             |
| 定期存款           | -                       | -                        |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                       | -                        |
| 存款期限 1-3 个月    | -                       | -                        |
| 存款期限 3 个月以上    | -                       | -                        |
| 其他存款           | -                       | -                        |
| 合计：            | 1,064,136.83            | 2,377,151.03             |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日  |                  |                  |
|---------------|--------------------------|------------------|------------------|
|               | 成本                       | 公允价值             | 公允价值变动           |
| 股票            | 328,312.00               | 303,000.00       | -25,312.00       |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                        | -                | -                |
| 债券            | 交易所市场                    | 330,107,493.84   | 330,864,863.90   |
|               | 银行间市场                    | 752,800,958.41   | 759,550,000.00   |
|               | 合计                       | 1,082,908,452.25 | 1,090,414,863.90 |
| 资产支持证券        | -                        | -                | -                |
| 基金            | -                        | -                | -                |
| 其他            | -                        | -                | -                |
| 合计            | 1,083,236,764.25         | 1,090,717,863.90 | 7,481,099.65     |
| 项目            | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |                  |                  |
|               | 成本                       | 公允价值             | 公允价值变动           |
| 股票            | 116,136,782.47           | 106,984,092.33   | -9,152,690.14    |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                        | -                | -                |
| 债券            | 交易所市场                    | 94,327,679.13    | 93,553,633.40    |
|               | 银行间市场                    | 828,562,291.34   | 823,023,000.00   |
|               | 合计                       | 922,889,970.47   | 916,576,633.40   |
| 资产支持证券        | -                        | -                | -                |
| 基金            | -                        | -                | -                |
| 其他            | -                        | -                | -                |
| 合计            | 1,039,026,752.94         | 1,023,560,725.73 | -15,466,027.21   |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 |           |
|-------|-------------------------|-----------|
|       | 账面余额                    | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                       | -         |
| 银行间市场 | -                       | -         |

|       |                          |           |
|-------|--------------------------|-----------|
| 合计    | -                        | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                        | -         |
| 银行间市场 | 29,500,244.25            | -         |
| 合计    | 29,500,244.25            | -         |

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末及上年度末，本基金未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 2,296.48                | 2,492.71                 |
| 应收定期存款利息   | -                       | -                        |
| 应收其他存款利息   | -                       | -                        |
| 应收结算备付金利息  | 7,588.70                | 1,480.60                 |
| 应收债券利息     | 20,625,056.92           | 16,168,712.86            |
| 应收资产支持证券利息 | -                       | -                        |
| 应收买入返售证券利息 | -                       | 26,092.65                |
| 应收申购款利息    | -                       | -                        |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                       | -                        |
| 其他         | 77.30                   | 49.90                    |
| 合计         | 20,635,019.40           | 16,198,828.72            |

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 209,117.65              | 1,635,183.89             |
| 银行间市场应付交易费用 | 22,753.92               | 7,967.83                 |
| 合计          | 231,871.57              | 1,643,151.72             |

### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | -                       | 1,677.91                 |
| 预提费用        | 389,000.00              | 340,000.00               |
| 合计          | 389,000.00              | 341,677.91               |

注：预提费用为按日计提的审计费、账户维护费和信息披露费。

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 |                 |
|---------------|--|-----------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额            |
| 上年度末          | 1,087,835,809.87                       | 848,619,085.43  |
| 本期申购          | 1,437,249.42                           | 1,121,209.89    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -414,865,330.06                        | -323,644,288.81 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                                      | -               |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                                      | -               |
| 本期申购          | -                                      | -               |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                      | -               |
| 本期末           | 674,407,729.23                         | 526,096,006.51  |

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 154,244,327.08 | 67,926,444.04  | 222,170,771.12 |
| 本期利润           | -5,811,274.82  | 22,947,126.86  | 17,135,852.04  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -56,536,524.02 | -29,398,077.96 | -85,934,601.98 |
| 其中：基金申购款       | 190,998.55     | 117,464.59     | 308,463.14     |
| 基金赎回款          | -56,727,522.57 | -29,515,542.55 | -86,243,065.12 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 91,896,528.24  | 61,475,492.94  | 153,372,021.18 |

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|           | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------|----------------------------------|----------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 141,512.73                       | 94,614.06                        |
| 定期存款利息收入  | -                                | 840,611.11                       |
| 其他存款利息收入  | -                                | -                                |
| 结算备付金利息收入 | 144,656.59                       | 11,087.72                        |
| 其他        | 2,434.45                         | 1,389.93                         |
| 合计        | 288,603.77                       | 947,702.82                       |

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|------------|--|---|
| 卖出股票成交总额   | 156,854,265.73                         | 115,211,954.52                              |
| 减：卖出股票成本总额 | 185,508,516.17                         | 110,059,028.94                              |
| 买卖股票差价收入   | -28,654,250.44                         | 5,152,925.58                                |

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |
|-------------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -731,598.88                 | -47,913,602.04                   |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                           | -                                |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                           | -                                |
| 合计                            | -731,598.88                 | -47,913,602.04                   |

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |
|----|-----------------------------|----------------------------------|
|----|-----------------------------|----------------------------------|

|                         |                  |                  |
|-------------------------|------------------|------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 3,004,375,608.66 | 2,612,312,025.45 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,957,575,226.58 | 2,604,829,594.74 |
| 减：应收利息总额                | 47,531,980.96    | 55,396,032.75    |
| 买卖债券差价收入                | -731,598.88      | -47,913,602.04   |

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |
|----------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额   | -                           | 30,159,000.00                    |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | -                           | 30,000,000.00                    |
| 减：应收利息总额       | -                           | 159,000.00                       |
| 资产支持证券投资收益     | -                           | -                                |

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |
|-------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 79,317.45                   | 1,041,233.10                     |
| 基金投资产生的股利收益 | -                           | -                                |
| 合计          | 79,317.45                   | 1,041,233.10                     |

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |
|------|-----------------------------|----------------------------------|
|      |                             |                                  |

|                        |               |               |
|------------------------|---------------|---------------|
| 1. 交易性金融资产             | 22,947,126.86 | 15,902,733.07 |
| ——股票投资                 | 9,127,378.14  | -6,086,092.74 |
| ——债券投资                 | 13,819,748.72 | 21,988,825.81 |
| ——资产支持证券投资             | -             | -             |
| ——贵金属投资                | -             | -             |
| ——其他                   | -             | -             |
| 2. 衍生工具                | -             | -             |
| ——权证投资                 | -             | -             |
| 3. 其他                  | -             | -             |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -             | -             |
| 合计                     | 22,947,126.86 | 15,902,733.07 |

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 46,968.60                   | 527,497.25                       |
| 基金转换费收入 | 785.60                      | 498.03                           |
| 合计      | 47,754.20                   | 527,995.28                       |

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 387,694.53                  | 372,423.13                       |
| 银行间市场交易费用 | 47,230.00                   | 28,055.00                        |
| 交易基金产生的费用 | -                           | -                                |
| 其中：申购费    | -                           | -                                |
| 赎回费       | -                           | -                                |
| 合计        | 434,924.53                  | 400,478.13                       |

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |
|----|-----------------------------|----------------------------------|
|    |                             |                                  |

|       |            |            |
|-------|------------|------------|
| 审计费用  | 80,000.00  | 40,000.00  |
| 信息披露费 | 200,000.00 | 200,000.00 |
| 账户维护费 | 46,200.00  | 37,400.00  |
| 合计    | 326,200.00 | 277,400.00 |

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 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        |

## 7.4.10 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。

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称          | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 |                      | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017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>成交总额的比<br>例 |
| 东北证券股<br>份有限公司 | 226,387,482.56              | 100.00%              | 253,668,458.94                   | 100.00%              |

#### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称          | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 |                      | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017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>成交总额的比<br>例 |
| 东北证券股<br>份有限公司 | 1,159,627,056.58            | 100.00%              | 463,562,316.68                   | 100.00%              |

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称          | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 |                            | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017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>成交总额的比<br>例 |
| 东北证券股<br>份有限公司 | 24,879,200,000.00           | 100.00%                    | 1,281,700,000.00                 | 100.00%                    |

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 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>2018年1月1日至2018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<br>份有限公司 | 209,117.65                       | 100.00%        | 209,117.65   | 100.00%          |
| 关联方名称          | 上年度可比期间<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<br>份有限公司 | 234,243.79                       | 100.00%        | 1,635,183.89 | 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。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|-----------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                 | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 10,625,561.48                    | 16,367,675.15                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,783,614.42                     | 3,537,222.71                     |

注：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

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。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,634,701.70                     | 2,518,103.86                     |

注：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

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。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间,本基金均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间,本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.10.4.2 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

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。

### 7.4.10.5 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>2018年1月1日至2018年12月31日 |            | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017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 | 1,064,136.83                | 141,512.73 | 2,377,151.03                     | 94,614.06 |

### 7.4.10.6 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。

### 7.4.11 利润分配情况

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,本基金本报告期末进行利润分配。

### 7.4.12 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 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。

#### 7.4.12.2 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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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 |
|------|------|-------|--------|-------|--------|
|------|------|-------|--------|-------|--------|

|           |                    |                   |        |           |                |
|-----------|--------------------|-------------------|--------|-----------|----------------|
| 101453027 | 14 晋煤<br>MTN001    | 2019 年 1 月<br>3 日 | 101.72 | 300,000   | 30,516,000.00  |
| 101653043 | 16 九龙仓<br>MTN001   | 2019 年 1 月<br>2 日 | 99.48  | 500,000   | 49,740,000.00  |
| 101652028 | 16 河钢集<br>MTN002   | 2019 年 1 月<br>3 日 | 101.04 | 200,000   | 20,208,000.00  |
| 101460041 | 14 济西城<br>投 MTN001 | 2019 年 1 月<br>2 日 | 101.49 | 200,000   | 20,298,000.00  |
| 101558008 | 15 赣国资<br>MTN001   | 2019 年 1 月<br>2 日 | 102.17 | 118,000   | 12,056,060.00  |
| 101754024 | 17 河钢集<br>MTN002   | 2019 年 1 月<br>3 日 | 102.03 | 200,000   | 20,406,000.00  |
| 101463009 | 14 大同煤<br>业 MTN001 | 2019 年 1 月<br>3 日 | 101.67 | 300,000   | 30,501,000.00  |
| 101658067 | 16 中药控<br>股 MTN001 | 2019 年 1 月<br>2 日 | 99.81  | 400,000   | 39,924,000.00  |
| 41800227  | 18 尧矿<br>CP003     | 2019 年 1 月<br>2 日 | 101.11 | 200,000   | 20,222,000.00  |
| 合计        |                    |                   |        | 2,418,000 | 243,871,060.00 |

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 211,300,000.00 元,于 2019 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资风险主要包括:信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系,确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险,从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、风险管理部和监察稽核部组成的风险管理组织体系,该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别,事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券；本基金持有一家上市公司的证券市值不超过基金资产净值的百分之十，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金在交易所进行交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场进行交易，在交易前均会对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | 20,222,000.00           | 40,000,000.00            |
| A-1 以下 | 0.00                    | 0.00                     |
| 未评级    | 30,057,000.00           | 77,519,000.00            |
| 合计     | 50,279,000.00           | 117,519,000.00           |

注：以上按短期信用评级的债券投资中仅包含短期融资券及超短期融资券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 949,225,932.80          | 739,191,633.40           |
| AAA 以下 | 50,913,931.10           | 0.00                     |
| 未评级    | 0.00                    | 0.00                     |
| 合计     | 1,000,139,863.90        | 739,191,633.40           |

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、短期融资券、超短期融资券及同业存单等。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 0.00                    | 0.00                     |
| AAA 以下 | 0.00                    | 0.00                     |
| 未评级    | 0.00                    | 0.00                     |
| 合计     | 0.00                    | 0.00                     |

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA    | 0.00                    | 48,612,727.28            |
| AAA 以下 | 0.00                    | 0.00                     |
| 未评级    | 0.00                    | 0.00                     |
| 合计     | 0.00                    | 48,612,727.28            |

注：上述同业存单按主体评级列示。

#### 7.4.13.3 流动性风险

所谓流动性风险指基金投资组合的证券会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。本基金的流动性风险主要来自两个方面，一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难。

本基金保持不低于基金资产净值百分之五的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除在本报告（7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券）中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本报告期末本基金的其余资产均能及时变现。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本基金管理人在流动性风险管理方面，每日预测本基金流动性需求并计算最优预留现金值，预留一部分现金以应付赎回的压力；通过分析每个资产类别以及每只证券的流动性风险，合理配置基金资产，并且严格跟踪和监控投资集中度，定期或不定期对基金投资组合流动性风险进行考察。

##### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，保持组合必要的流动性和可变现能力，未发生流动性风险。

### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险指的是由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险；市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和负债不计息，持有的利率敏感性资产主要为银行存款及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2018年12月<br>31日 | 1年以内           | 1-5年           | 5年以上          | 不计息        | 合计               |
|------------------------|----------------|----------------|---------------|------------|------------------|
| 资产                     |                |                |               |            |                  |
| 银行存款                   | 1,064,136.83   | 0.00           | 0.00          | 0.00       | 1,064,136.83     |
| 结算备付金                  | 16,863,672.96  | 0.00           | 0.00          | 0.00       | 16,863,672.96    |
| 存出保证金                  | 171,870.63     | 0.00           | 0.00          | 0.00       | 171,870.63       |
| 交易性金融资产-股票投资           | 0.00           | 0.00           | 0.00          | 303,000.00 | 303,000.00       |
| 交易性金融资产-债券投资           | 702,871,000.00 | 376,612,932.80 | 10,930,931.10 | 0.00       | 1,090,414,863.90 |
| 交易性金融资产-资产支持证券投资       | 0.00           | 0.00           | 0.00          | 0.00       | 0.00             |

|                         |                |                |               |                |                  |
|-------------------------|----------------|----------------|---------------|----------------|------------------|
| 买入返售金<br>融资产            | 0.00           | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00             |
| 应收证券清<br>算款             | 0.00           | 0.00           | 0.00          | 99,990.39      | 99,990.39        |
| 应收利息                    | 0.00           | 0.00           | 0.00          | 20,635,019.40  | 20,635,019.40    |
| 应收股利                    | 0.00           | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00             |
| 应收申购款                   | 0.00           | 0.00           | 0.00          | 2,975.34       | 2,975.34         |
| 资产总计                    | 720,970,680.42 | 376,612,932.80 | 10,930,931.10 | 21,040,985.13  | 1,129,555,529.45 |
| 负债                      |                |                |               |                |                  |
| 卖出回购金<br>融资产款           | 447,763,045.30 | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 447,763,045.30   |
| 应付赎回款                   | 0.00           | 0.00           | 0.00          | 600,767.84     | 600,767.84       |
| 应付管理人<br>报酬             | 0.00           | 0.00           | 0.00          | 755,872.30     | 755,872.30       |
| 应付托管费                   | 0.00           | 0.00           | 0.00          | 116,288.03     | 116,288.03       |
| 应付交易费<br>用              | 0.00           | 0.00           | 0.00          | 231,871.57     | 231,871.57       |
| 应付销售服<br>务费             | 0.00           | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00             |
| 应交税费                    | 0.00           | 0.00           | 0.00          | 124,450.69     | 124,450.69       |
| 应付利息                    | 0.00           | 0.00           | 0.00          | 106,206.03     | 106,206.03       |
| 其他负债                    | 0.00           | 0.00           | 0.00          | 389,000.00     | 389,000.00       |
| 应付证券清<br>算款             | 0.00           | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00             |
| 负债总计                    | 447,763,045.30 | 0.00           | 0.00          | 2,324,456.46   | 450,087,501.76   |
| 利率敏感度<br>缺口             | 273,207,635.12 | 376,612,932.80 | 10,930,931.10 | 18,716,528.67  | 679,468,027.69   |
| 上年度末<br>2017年12月<br>31日 | 1年以内           | 1-5年           | 5年以上          | 不计息            | 合计               |
| 资产                      |                |                |               |                |                  |
| 银行存款                    | 2,377,151.03   | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 2,377,151.03     |
| 结算备付金                   | 3,290,174.12   | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 3,290,174.12     |
| 存出保证金                   | 110,964.76     | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 110,964.76       |
| 交易性金融<br>资产-股票<br>投资    | 0.00           | 0.00           | 0.00          | 106,984,092.33 | 106,984,092.33   |
| 交易性金融<br>资产-债券<br>投资    | 377,923,000.00 | 538,653,633.40 | 0.00          | 0.00           | 916,576,633.40   |
| 买入返售金<br>融资产            | 29,500,244.25  | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 29,500,244.25    |
| 应收证券清                   | 0.00           | 0.00           | 0.00          | 0.00           | 0.00             |

|               |                |                |      |                |                  |
|---------------|----------------|----------------|------|----------------|------------------|
| 算款            |                |                |      |                |                  |
| 应收利息          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 16,198,828.72  | 16,198,828.72    |
| 应收股利          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00           | 0.00             |
| 应收申购款         | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 4,852.28       | 4,852.28         |
| 资产总计          | 413,201,534.16 | 538,653,633.40 | 0.00 | 123,187,773.33 | 1,075,042,940.89 |
| 负债            |                |                |      |                |                  |
| 卖出回购金<br>融资产款 | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00           | 0.00             |
| 应付赎回款         | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 897,995.29     | 897,995.29       |
| 应付管理人<br>报酬   | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 1,187,558.14   | 1,187,558.14     |
| 应付托管费         | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 182,701.28     | 182,701.28       |
| 应付交易费<br>用    | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 1,643,151.72   | 1,643,151.72     |
| 应付销售服<br>务费   | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00           | 0.00             |
| 应付利息          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00           | 0.00             |
| 其他负债          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 341,677.91     | 341,677.91       |
| 应付证券清<br>算款   | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 0.00           | 0.00             |
| 负债总计          | 0.00           | 0.00           | 0.00 | 4,253,084.34   | 4,253,084.34     |
| 利率敏感度<br>缺口   | 413,201,534.16 | 538,653,633.40 | 0.00 | 118,934,688.99 | 1,070,789,856.55 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |  |                                 |                   |
|----|--|---------------------------------|-------------------|
| 假设 | 假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响 |                                 |                   |
| 分析 | 相关风险变量的变动  | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                   |
|    |  | 本期末（2018年12月31日）                | 上年度末（2017年12月31日） |
|    | 市场利率下调 0.25%   | 1,446,670.00                    | 1,713,489.09      |
|    | 市场利率上调 0.25%   | -3,525,310.65                   | -3,331,393.37     |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的

公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |                       |
|---------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|               | 公允价值                    | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 303,000.00              | 0.04                     | 106,984,092.33           | 9.99                  |
| 交易性金融资产-基金投资  | -                       | -                        | -                        | -                     |
| 交易性金融资产-债券投资  | 1,090,414,863.90        | 160.48                   | 916,576,633.40           | 85.60                 |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | -                       | -                        | -                        | -                     |
| 衍生金融资产-权证投资   | -                       | -                        | -                        | -                     |
| 其他            | -                       | -                        | -                        | -                     |
| 合计            | 1,090,717,863.90        | 160.53                   | 1,023,560,725.73         | 95.59                 |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |  |                             |                        |
|----|--|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动                           |                             |                        |
|    | Beta 系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票，默认其波动与市场同步 |                             |                        |
|    | 假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动                              |                             |                        |
| 分析 | 相关风险变量的变动  | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |  | 本期末（2018 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2017 年 12 月 31 日） |
|    | 沪深 300 指数下跌 5%   | -12,871.57                  | -3,803,114.23          |
|    | 沪深 300 指数上涨 5%   | 12,871.57                   | 3,803,114.23           |

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金在 95%的置信水平下，以过去 100 个交易日为风险样本观察期，计算前瞻天数为 1 天

的风险价值。本期末本基金风险价值为 1,528,728.45 元，占基金资产净值比例为 0.22%；上年度末本基金风险价值为 1,810,097.41 元，占基金资产净值比例为 0.17%。

#### **7.4.14 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              | 303,000.00       | 0.03          |
|    | 其中：股票             | 303,000.00       | 0.03          |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 1,090,414,863.90 | 96.53         |
|    | 其中：债券             | 1,090,414,863.90 | 96.53         |
|    | 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          | -                | -             |
|    | 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      | 17,927,809.79    | 1.59          |
| 8  | 其他各项资产            | 20,909,855.76    | 1.85          |
| 9  | 合计                | 1,129,555,529.45 | 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              | -          | -             |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -          | -             |
| E  | 建筑业              | -          | -             |
| F  | 批发和零售业           | -          | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 303,000.00 | 0.04          |
| 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              | -          | -             |
| 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        | 303,000.00 | 0.04 |

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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  | 002120 | 韵达股份 | 10,000 | 303,000.00 | 0.04         |

### 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  | 600579 | 天华院   | 9,004,739.00 | 0.84           |
| 2  | 300429 | 强力新材  | 8,832,770.20 | 0.82           |
| 3  | 600197 | 伊力特   | 8,554,866.45 | 0.80           |
| 4  | 000823 | 超声电子  | 6,338,857.76 | 0.59           |
| 5  | 601857 | 中国石油  | 5,245,435.00 | 0.49           |
| 6  | 600048 | 保利地产  | 5,150,299.77 | 0.48           |
| 7  | 002375 | 亚厦股份  | 3,949,673.23 | 0.37           |
| 8  | 000069 | 华侨城 A | 3,625,008.00 | 0.34           |
| 9  | 600188 | 兖州煤业  | 3,623,945.00 | 0.34           |
| 10 | 600030 | 中信证券  | 2,000,580.00 | 0.19           |
| 11 | 601766 | 中国中车  | 943,104.00   | 0.09           |
| 12 | 600362 | 江西铜业  | 937,435.25   | 0.09           |
| 13 | 603298 | 杭叉集团  | 882,193.00   | 0.08           |
| 14 | 601600 | 中国铝业  | 820,590.00   | 0.08           |
| 15 | 000002 | 万科 A  | 728,863.91   | 0.07           |
| 16 | 600276 | 恒瑞医药  | 700,239.26   | 0.07           |
| 17 | 603288 | 海天味业  | 689,000.00   | 0.06           |
| 18 | 600519 | 贵州茅台  | 682,576.00   | 0.06           |
| 19 | 002027 | 分众传媒  | 664,231.00   | 0.06           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 20 | 601166 | 兴业银行 | 618,947.00 | 0.06 |
|----|--------|------|------------|------|

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  | 600754 | 锦江股份  | 17,303,270.61 | 1.62           |
| 2  | 000959 | 首钢股份  | 16,372,225.83 | 1.53           |
| 3  | 600681 | 百川能源  | 11,180,861.62 | 1.04           |
| 4  | 601166 | 兴业银行  | 9,863,503.00  | 0.92           |
| 5  | 600579 | 天华院   | 9,750,957.31  | 0.91           |
| 6  | 300429 | 强力新材  | 8,219,907.20  | 0.77           |
| 7  | 002481 | 双塔食品  | 8,125,858.00  | 0.76           |
| 8  | 002531 | 天顺风能  | 7,275,333.88  | 0.68           |
| 9  | 600197 | 伊力特   | 6,726,492.00  | 0.63           |
| 10 | 000971 | 高升控股  | 6,155,917.00  | 0.57           |
| 11 | 000823 | 超声电子  | 5,994,322.97  | 0.56           |
| 12 | 600804 | 鹏博士   | 5,918,459.99  | 0.55           |
| 13 | 603839 | 安正时尚  | 5,688,845.00  | 0.53           |
| 14 | 601857 | 中国石油  | 5,392,250.00  | 0.50           |
| 15 | 600048 | 保利地产  | 4,505,266.09  | 0.42           |
| 16 | 600500 | 中化国际  | 4,269,976.00  | 0.40           |
| 17 | 600188 | 兖州煤业  | 3,836,843.96  | 0.36           |
| 18 | 000069 | 华侨城 A | 3,595,150.00  | 0.34           |
| 19 | 002375 | 亚厦股份  | 3,120,835.26  | 0.29           |
| 20 | 600030 | 中信证券  | 1,891,039.00  | 0.18           |

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 | 69,700,045.70  |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 156,854,265.73 |

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。

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      | 39,996,000.00    | 5.89         |
|    | 其中：政策性金融债 | 39,996,000.00    | 5.89         |
| 4  | 企业债券      | 365,785,825.30   | 53.83        |
| 5  | 企业短期融资券   | 50,279,000.00    | 7.40         |
| 6  | 中期票据      | 627,626,000.00   | 92.37        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 6,728,038.60     | 0.99         |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,090,414,863.90 | 160.48       |

### 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 | 50,935,000.00 | 7.50         |
| 2  | 122284    | 13 鲁金 02      | 500,000 | 50,880,000.00 | 7.49         |
| 3  | 122373    | 15 舟港债        | 500,000 | 50,220,000.00 | 7.39         |
| 4  | 122975    | 09 济城建        | 500,000 | 50,090,000.00 | 7.37         |
| 5  | 101653043 | 16 九龙仓 MTN001 | 500,000 | 49,740,000.00 | 7.32         |

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

### 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

本基金本报告期内未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金所持有 13 鄂联投 MTN1 (1382234. IB) 于 2017 年 4 月 26 日对外公告了其高级管理人员涉嫌违纪接受组织审查的事宜。湖北省联合发展投资集团有限公司(以下简称“公司”)于 2017 年 4 月 26 日发布公告,公告称,公司党委委员、副总经理祝向军涉嫌严重违纪,目前正在接受组织审查。公司目前经营一切正常,审查不会对公司正常生产经营造成影响。

本基金所持有 16 阳煤 MTN001 (101660034. IB) 于 2018 年 7 月 31 日对外公告了收到行政监管措施决定书的事宜。阳泉煤业(集团)有限责任公司(以下简称“公司”)于 2018 年 7 月 31 日发布公告,公告称,公司近日收到中国证券监督管理委员会山西证监局对旗下子公司阳煤化工股份有限公司(以下简称“阳煤化工”)下达的行政监管措施决定书《关于对阳煤化工股份有限公司采取责令改正措施的决定》(〔2018〕第 8 号),主原因有二,其一,2017 年度阳煤化工部分关联采购金额超过 2016 年经审计净资产的 5%,未在日常关联交易中预计,未单独履行审议程序并披露,且 2017 年年报披露不完整,其二,截止 2016 年 12 月 31 日,阳煤化工未弥补亏损金额超过实收股本总额 1/3,未按规定在事实发生之日起 2 个月内召开临时股东大会对该事项进行审议,规范运作不到位。阳煤化工已于 2018 年 8 月 15 日召开第三次临时股东大会,对议案进行审议。

本基金决策依据及投资程序:

(1) 研究:本基金的投资研究主要依托于公司整体的研究平台,由研究部负责,采用自上而下和自下而上相结合的方式。通过对全球宏观经济形势、中国经济发展趋势进行分析,深入研究国家宏观经济走势、政策走向和利率变化趋势;通过对信用利差的分析判断,可转债的投资价值分析等,深入研究各类债券合理的投资价值。在全面深入研究的基础上,提出大类资产配置建议、目标久期建议、类属资产配置建议等。

(2) 资产配置决策:投资决策委员会依据上述研究报告,对基金的资产配置比例、目标久期设定等提出指导性意见。基金经理基于投研部门的投资建议,根据自己对未来一段时期内宏观经

济走势的基本判断，对基金资产的投资，制定月度资产配置和久期设置计划，并报投资决策委员会审批，审批通过，方可按计划执行。

(3) 组合构建：大类资产配置比例范围及目标久期设定范围确定后，基金经理参考研究员的投资建议，结合自身的研究判断，决定具体的投资品种并决定买卖时机，其中重大单项投资决定需经投资总监或投资决策委员会审批。

(4) 交易执行：交易管理部负责具体的交易执行，依据基金经理的指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易。

(5) 风险监控：本基金管理人各相关业务部门对投资组合计划的执行过程进行监控，定期向风险控制委员会汇报。风险控制委员会根据风险监控情况，责令投资不规范的基金经理进行检讨，并及时调整。

(6) 风险绩效评估：风险管理部定期和不定期对基金的投资进行风险绩效评估，并提供相关报告，使投资决策委员会和基金经理能够更加清楚组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略，并了解组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否。基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整和优化投资组合。

(7) 组合调整：基金经理将依据宏观经济状况、证券市场和上市公司的发展变化，以及组合风险与绩效的评估结果，结合基金申购和赎回的现金流量情况，对投资组合进行动态调整，使之不断得到优化。

本基金投资 13 鄂联投 MTN1 主要基于以下原因：

13 鄂联投 MTN1 的债项评级为 AAA，主体评级为 AAA，表明发行人偿还债务的能力较强，受不利经济环境的影响不大，违约风险较低。

湖北省联合发展投资集团有限公司是经湖北省人民政府批准，以湖北省国资委和武汉城市圈九市国资委作为主要出资人，并引入武汉钢铁(集团)公司、东风汽车公司、中国长江三峡工程开发总公司、中国三江航天工业集团公司、中国葛洲坝集团股份有限公司、湖北中烟工业有限责任公司、中国烟草总公司湖北省公司七家湖北省内大型企业作为战略投资人，于 2008 年 7 月 7 日在湖北省工商行政管理局注册成立的大型国有控股企业。公司核心子公司具有明显的品牌优势。其中：1、湖北路桥在前期的发展历程中，以主力军的身份，承担了湖北省内的桥梁和高速公路建设，在其他省市区域也承担了多项桥梁、隧道、高速公路施工任务，以“优质高效、信守合同”赢得客户良好的满意度。2、联交投拥有的高速公路是武汉城市圈交通运输和连接国家路网的主要干线公路，在湖北省内已形成良好的路网布局，为缓解湖北省交通运输瓶颈制约起到了良好的作用，在公路建设和运营管理领域建立了良好的市场品牌。3、公司代表湖北省政府出资与铁道部共同建

设的城际铁路，目前是全国唯一全面开工建设的城际铁路之一，为其他省、市城际铁路建设树立了样板形象。

本基金投资 16 阳煤 MTN001 主要基于以下原因：

16 阳煤 MTN001 的债项评级为 AAA，主体评级为 AAA，表明发行人偿还债务的能力较强，受不利经济环境的影响不大，违约风险较低。

阳泉煤业(集团)有限责任公司是全国最大的无烟煤生产基地和喷吹煤加工基地之一，具有较大的市场占有率和影响力。作为煤炭行业首家注册商标的煤炭企业，“阳优”品牌已经取得了良好的品牌效应。公司已通过 ISO9000—14000 质量体系认证和山西省技术监督局的质量认证。公司煤炭产品优质稳定，行销全国 15 个省市、100 多个用户，出口日本、韩国、巴西、比利时等国，销量逐年递增。冶金用煤国内主要供应鞍钢、首钢、唐钢、本钢等国内重点大型钢铁企业，出口到日本新日铁、NKK、住友金属、韩国浦项、德国克虏伯等世界一流钢铁企业集团。

除上述情况外，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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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   | 171,870.63    |
| 2  | 应收证券清算款 | 99,990.39     |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 20,635,019.40 |
| 5  | 应收申购款   | 2,975.34      |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 20,909,855.76 |

### 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处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 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 |
| 6,750        | 99,912.26     | 192,827,683.39 | 28.59%     | 481,580,045.84 | 71.41%     |

### 9.2 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<br>持有本基金 | 1.00       | 0.00%    |

### 9.3 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<br>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               | 1,087,835,809.87 |
| 本报告期期间基金总申购份额              | 1,437,249.42     |
| 减:本报告期期间基金总赎回份额            | 414,865,330.06   |
| 本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                |
| 本报告期期末基金份额总额               | 674,407,729.23   |

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

报告期内，公司存在一起劳动争议，截至报告期末已审理终结。

本报告期，无涉及基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

### 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 80,000.00 元；截至 2018 年 12 月 31 日，该审计机构已向本基金提供 6 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 | 2      | 226,387,482.56 | 100.00%      | 209,117.65 | 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资金雄厚，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：由研究部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 | 1,159,627,056.58 | 100.00%      | 24,879,200,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                   | 法定披露方式  | 法定披露日期      |
|----|--|---------|-------------|
| 1  | 关于旗下基金参与中国农业银行基金申购及定投优惠活动的公告（清洁版）      | 指定报刊、网站 | 2018年12月28日 |
| 2  | 关于参加 2019 年邮储银行网上银行及手机银行费率优惠活动的公告（清洁版） | 指定报刊、网站 | 2018年12月28日 |

|    |   |         |                  |
|----|---|---------|------------------|
| 3  | 关于参与嘉实财富管理有限公司费率优惠活动的公告                               | 指定报刊、网站 | 2018 年 12 月 18 日 |
| 4  | 关于增加中民财富基金销售(上海)有限公司为旗下基金销售机构并开通定投、转换业务同时参与其费率优惠活动的公告 | 指定报刊、网站 | 2018 年 12 月 14 日 |
| 5  | 关于增加华金证券股份有限公司为东方精选等 9 只基金销售机构及开通转换业务的公告              | 指定报刊、网站 | 2018 年 12 月 12 日 |
| 6  | 关于参与上海基煜基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告                           | 指定报刊、网站 | 2018 年 12 月 11 日 |
| 7  | 关于参与金惠家保险代理有限公司费率优惠活动的公告                              | 指定报刊、网站 | 2018 年 11 月 19 日 |
| 8  | 关于增加华龙证券为旗下基金销售机构及开通定投、转换业务并参与其申购及定投费率优惠活动的公告         | 指定报刊、网站 | 2018 年 11 月 17 日 |
| 9  | 关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下基金销售机构并开通定投、转换业务同时参与其费率优惠活动的公告     | 指定报刊、网站 | 2018 年 11 月 12 日 |
| 10 | 关于增加晋商银行为旗下基金销售渠道并开通定投及转换业务的公告                        | 指定报刊、网站 | 2018 年 11 月 6 日  |
| 11 | 关于旗下部分基金参与上海凯石财富基金管理有限公司费率优惠活动的公告                     | 指定报刊、网站 | 2018 年 8 月 29 日  |
| 12 | 关于在东海证券开通旗下基金定投业务并参与定期定额投资费率                          | 指定报刊、网站 | 2018 年 8 月 29 日  |

|    |                                     |         |                 |
|----|-------------------------------------|---------|-----------------|
|    | 优惠活动的公告                             |         |                 |
| 13 | 关于在中金公司开通旗下基金定投业务并参与定期定额投资费率优惠活动的公告 | 指定报刊、网站 | 2018 年 8 月 29 日 |

## § 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    | -              | 20180101 - 20180403     | 298,966,800.66 | -    | 298,966,800.66 | -              | -      |
|       | -              | 20180404 - 20181231     | 192,446,448.35 | -    | -              | 192,446,448.35 | 28.54% |
| 个人    | -              | -                       | -              | -    | -              | -              | -      |
| -     | -              | -                       | -              | -    | -              | -              | -      |

#### 产品特有风险

基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。

(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。

(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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 一、《东方安心收益保本混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方安心收益保本混合型证券投资基金托管协议》
- 三、东方基金管理有限责任公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告

### 13.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所，投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)）查阅。

### 13.3 查阅方式

本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

东方基金管理有限责任公司

2019年3月28日