东方稳健回报债券型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方稳健回报债券
基金主代码	400009
交易代码	400009
前端交易代码	400009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年12月10日
报告期末基金份额总额	1,179,913,209.28份
投资目标	在控制风险和确保资产流动性的前提下,追求较高总回报率,力争实现基金资产长期稳定增值。
投资策略	本基金奉行"积极投资、稳健增值"的投资理念,在保持组合较低波动性的同时,采用稳健的资产配置策略和多种积极管理增值手段,实现较高的总回报率。
业绩比较基准	中债总指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。在债券型基金产品中,其长期平均风险和预期收益率低于直接参与二级市场股票、权证投资的债券型基金,高于纯债券型基金。
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	23,841,990.20
2.本期利润	29,635,038.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.0218
4.期末基金资产净值	1,392,047,185.36
5.期末基金份额净值	1.180

注:①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

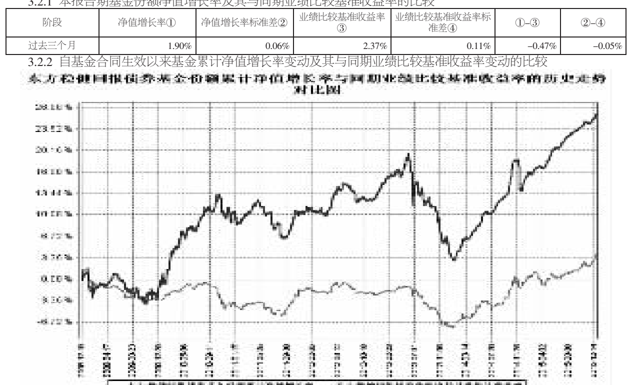
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.90%	0.06%	2.37%	0.11%	-0.47%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

东方稳健回报债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李仆(先生)	本基金基金经理、固定收益部总经理、投资决策委员会委员	2014年10月13日	-	15年	15年证券从业经历,曾任宝钢集团财务有限责任公司投资经理、宝钢集团有限公司投资经理、宝岛(香港)贸易有限公司投资部总经理、华宝信托有限责任公司资管部投资副总监、信诚基金管理有限公司基金经理。2014年2月加盟东方基金管理有限责任公司,现任固定收益部总经理、投资决策委员会委员、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方永润18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方稳定增利债券型证券投资基金基金经理。
徐昀君(先生)	本基金基金经理、固定收益部总经理助理	2013年12月24日	-	7年	对外经济贸易大学金融学硕士,CFA,FRM,7年证券从业经历。曾任安信证券资产管理部研究员、投资经理,华西证券资产管理部投资经理。2013年3月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理助理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理。现任固定收益部总经理助理,东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方双债添利债券型证券基金基金经理、东方添益债券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、东方永润18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注:①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方稳健回报债券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作基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),制定了《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法,各投资组合经理在授权范围内自主决策,各投资组合共享研究平台,在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易,基金管理人执行交易系统中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

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

本报告期内,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合,未直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年四季度,宏观经济边际小幅改善但仍处低位,中采制造业景气指数连续五个月低于荣枯线。具体来看,1至11月工业企业利润总额同比下跌1.9%,单月利润总额同比增速连续六个月为负值,显示工业企业需求较为疲弱、盈利下降;11月工业增加值同比增长6.2%,房地产投资持续下行,供给侧的库存去化和产能出清仍在推进;美联储加息的靴子落地、人民币入篮SDR打开资本流动空间,人民币贬值压力不减;叠加大宗商品低迷、工业通缩压力不减等因素,我国宏观经济仍不乐观、继续探底。

在经济低位徘徊、人民币贬值的压力下,2015年四季度积极的财政政策与宽松的货币政策共同配合发力。财政政策方面,财政赤字不断加大,政策性银行发行专项金融债对重点领域"定向滴灌",由中央财政进行贴息;货币政策方面,2015年四季度央行降准50BP、降息25BP,并通过中期借贷便利操作等工具释放流动性,然而资金脱实向虚形势依然严峻。

2015年四季度债券市场收益率下行幅度较大,长端十年国债下行近40BP,十年国开债下行近60BP。10月,央行再次双降,开启低利率时代;11月,证监会宣布新股上市重启,中国证券登记结算有限公司宣布对债券回购标准券折算率进行动态调整,但事件对市场冲击有限;12月市场供需矛盾较大,机构到期配置热情较高,提前建仓带动收益率快速下行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年10月1日起至2015年12月31日,本基金净值增长率为1.90%,业绩比较基准收益率为2.37%,低于业绩比较基准0.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年一季度,受制于春节等因素,国内宏观经济仍难大幅回升、工业生产景气度仍偏低;欧央行、美联储货币政策分化加大国际宏观经济的波动,新兴市场经济脆弱仍面临考验;2016年国内外的宏观经济不确定性将远远大于2015年。

从货币政策角度来看,在经济低迷、资本外流、企业杠杆较高的压力下,2016年宽松空间仍存,人民币贬值、外汇占款流出将不得不需要数量型工具对冲,降准空间较大。从财政政策角度来看,在我国经济尚未企稳的情况下,预计2016年财政赤字或上调至3%,地方债务置换、专项金融债、新投资项目将继续发力。

从资金角度来看,2015年的多次双降已经大幅带动资金利率下行,在央行着力建立利率走廊的背景下,预计2016年资金波动区间将有所收窄,公开市场逆回购利率仍有下行空间,仍需关注股债流动性切换。

对于2016年一季度债券市场而言,供需两旺的背景下收益率有望再下一城,国债、地方债净增量将大幅提升,银行理财、保险的再配置压力较大。考虑到国内外宏观不确定性增强、债券收益率已处低位,机构谨慎心态可能较为强烈,预计2016年债市难改震荡性格局,将重点关注利率债的波段交易价值,利率较高的地方债、高等级信用债、优质ABS等类固收产品也具有较好的投资价值。汇率风险、信用风险、政治风险将加大市场的波动。

未来,本基金一方面将坚持以信用债的票息为基础收益来源,实现绝对收益,另一方面将积极参与波段操作,增强组合收益。

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 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,061,339,967.61	95.07
	其中:债券	2,061,339,967.61	95.07
	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	24,242,183.22	1.12
8	其他资产	82,752,380.09	3.82
9	合计	2,168,334,530.92	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	412,674,500.00	29.65
	其中:政策性金融债	382,380,500.00	27.47
4	企业债券	1,081,818,217.01	77.71
5	企业短期融资券	472,273,700.00	33.93
6	中期票据	73,506,000.00	5.28
7	可转债	1,039,550.60	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	20,028,000.00	1.44
10	合计	2,061,339,967.61	148.08

注:"其他"为地方政府债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150218	15国开18	2,100,000	220,542,000.00	15.84
2	150210	15国开10	800,000	86,688,000.00	6.23
3	1480501	14安康高新债	500,000	54,530,000.00	3.92
4	041555011	15冀建投CP001	497,000	50,246,700.00	3.61
5	011599835	15张江高科SCP001	500,000	50,090,000.00	3.60

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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

5.10.2

根据基金合同的规定,本基金可投资于一级市场新股网上申购,公开增发新股、可转换债券转股、股票或可分离交易债券派发的权证。本报告期内本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,173.06
2	应收证券清算款	36,959,784.66
3	应收股利	-
4	应收利息	45,730,826.20
5	应收申购款	55,596.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	82,752,380.09

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,761,704,252.11
报告期期间基金总申购份额	275,544,833.02
减:报告期期间基金总赎回份额	857,335,875.85
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,179,913,209.28

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有过本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

一、《东方稳健回报债券型证券投资基金基金合同》

二、《东方稳健回报债券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、基金份额净值及其临时公告

8.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

8.3 查阅方式

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

东方基金管理有限责任公司
2016年1月20日

东方添益债券型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方添益债券
基金主代码	400030
交易代码	400030
前端交易代码	400030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月15日
报告期末基金份额总额	477,551,537.83份
投资目标	在适度承担信用风险并保持基金资产流动性的条件下,对固定收益类资产进行积极主动的投资管理,实现基金资产长期、稳定的投资回报。
投资策略	本基金通过对宏观经济运行情况和金融市场运行趋势及国家政策趋向和市场利率水平变化特点等进行分析,判断我国债券市场中期和长期的运行情况以及风险收益波动特征,通过选取具有投资价值的个券,实现基金的持续稳定增值。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低预期风险品种,其长期平均预期风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	6,936,119.00
2.本期利润	7,551,191.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.0174
4.期末基金资产净值	522,325,066.40
5.期末基金份额净值	1.0938

注:①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

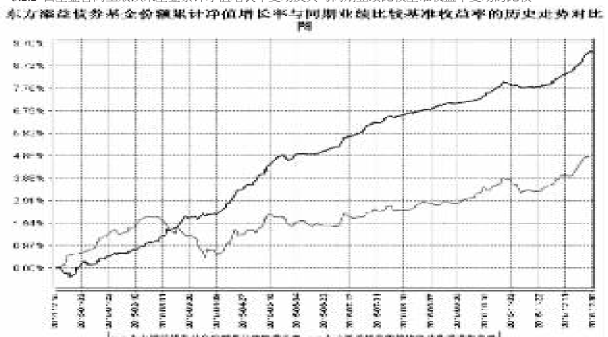
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.06%	0.05%	1.81%	0.08%	0.25%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

东方添益债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金基金合同于2014年12月15日生效,建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐昀君(先生)	本基金基金经理、固定收益部总经理助理	2014年12月15日	-	7年	对外经济贸易大学金融学硕士,CFA,FRM,7年证券从业经历。曾任安信证券资产管理部研究员、投资经理,华西证券资产管理部投资经理。2013年3月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理助理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理。现任固定收益部总经理助理,东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方双债添利债券型证券基金基金经理、东方添益债券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、东方永润18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注:①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方添益债券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作基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),制定了《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法,各投资组合经理在授权范围内自主决策,各投资组合共享研究平台,在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易,基金管理人执行交易系统中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

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

本报告期内,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合,未直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年四季度,宏观经济边际小幅改善但仍处低位,中采制造业景气指数连续五个月低于荣枯线。具体来看,1至11月工业企业利润总额同比下跌1.9%,单月利润总额同比增速连续六个月为负值,显示工业企业需求较为疲弱、盈利下降;11月工业增加值同比增长6.2%,房地产投资持续下行,供给侧的库存去化和产能出清仍在推进;美联储加息的靴子落地、人民币入篮SDR打开资本流动空间,人民币贬值压力不减;叠加大宗商品低迷、工业通缩压力不减等因素,我国宏观经济仍不乐观、继续探底。

在经济低位徘徊、人民币贬值的压力下,2015年四季度积极的财政政策与宽松的货币政策共同配合发力。财政政策方面,财政赤字不断加大,政策性银行发行专项金融债对重点领域"定向滴灌",由中央财政进行贴息;货币政策方面,2015年四季度央行降准50BP、降息25BP,并通过中期借贷便利操作等工具释放流动性,然而资金脱实向虚形势依然严峻。

2015年四季度债券市场收益率下行幅度较大,长端十年国债下行近40BP,十年国开债下行近60BP。10月,央行再次双降,开启低利率时代;11月,证监会宣布新股上市重启,中国证券登记结算有限公司宣布对债券回购标准券折算率进行动态调整,但对市场冲击有限;12月市场供需矛盾较大,机构到期配置热情较高,提前建仓带动收益率快速下行。

报告期内,本基金适度拉长了久期,获得了较好的绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年10月1日起至2015年12月31日,本基金净值增长率为2.06%,业绩比较基准收益率为1.81%,高于业绩比较基准0.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年一季度,受制于春节等因素,国内宏观经济仍难大幅回升、工业生产景气度仍偏低;欧央行、美联储货币政策分化加大国际宏观经济的波动,新兴市场经济脆弱仍面临考验;2016年国内外的宏观经济不确定性将远远大于2015年。

从货币政策角度来看,在经济低迷、资本外流、企业杠杆较高的压力下,2016年宽松空间仍存,人民币贬值、外汇占款流出将不得不需要数量型工具对冲,降准空间较大。从财政政策角度来看,在我国经济尚未企稳的情况下,预计2016年财政赤字或上调至3%,地方债务置换、专项金融债、新投资项目将继续发力。

从资金角度来看,2015年的多次双降已经大幅带动资金利率下行,在央行着力建立利率走廊的背景下,预计2016年资金波动区间将有所收窄,公开市场逆回购利率仍有下行空间,仍需关注股债流动性切换。

对于2016年一季度债券市场而言,供需两旺的背景下收益率有望再下一城,国债、地方债净增量将大幅提升,银行理财、保险的再配置压力较大。考虑到国内外宏观不确定性增强、债券收益率已处低位,机构谨慎心态可能较为强烈,预计2016年债市难改震荡性格局,将重点关注利率债的波段交易价值,利率较高的地方债、高等级信用债、优质ABS等类固收产品也具有较好的投资价值。汇率风险、信用风险、政治风险将加大市场的波动。

未来,本基金一方面将坚持以信用债的票息为基础收益来源,实现绝对收益,另一方面将积极参与波段操作,增强组合收益。

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 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	640,602,570.92	88.40
	其中:债券	640,602,570.92	88.40
	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	68,241,440.43	9.42
8	其他资产	15,828,810.23	2.18
9	合计	724,672,821.58	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	9,993,000.00	1.91
2	央行票据	-	-
3	金融债券	62,356,000.00	11.94
	其中:政策性金融债	62,356,000.00	11.94
4	企业债券	518,129,570.92	99.20
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	50,124,000.00	9.60
10	合计	640,602,570.92	122.64

注:"其他"为地方政府债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1380309	13永州城投债	300,000	32,427,000.00	6.21
2	1280305	12合力债	300,000	32,157,000.00	6.16
3	150218	15国开18	300,000	31,506,000.00	6.03
4	1280048	12五华国投债	390,000	31,227,300.00	5.98
5	130637	15河南09	300,000	30,096,000.00	5.76

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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

5.10.2

根据基金合同的规定,本基金的投资范围包括国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券、资产支持证券、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款等固定收益类资产。本报告期内本基金未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	19,096.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,753,967.09
5	应收申购款	55,746.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,828,810.23

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	381,140,526.38
报告期期间基金总申购份额	512,287,925.88
减:报告期期间基金总赎回份额	415,876,914.43
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	477,551,537.83

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有过本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

一、《东方添益债券型证券投资基金基金合同》

二、《东方添益债券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、基金份额净值及其临时公告

8.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

8.3 查阅方式

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

东方基金管理有限责任公司
2016年1月20日

东方双债添利债券型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015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:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方双债添利债券	
基金主代码	400027	
交易代码	400027	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年9月24日	
报告期末基金份额总额	276,101,359.83份	
投资目标	在适度承担信用风险并保持基金资产流动性的条件下,对固定收益类资产进行积极主动的投资管理,在此基础上通过个股精选配置权益类资产,实现基金资产长期、稳定的投资回报。	
投资策略	本基金主要投资于债券市场,在严控投资风险的基础上,通过投资于股票市场提高投资收益。本基金紧密跟踪债券市场与股票市场的运行情况和风险收益特征,结合对宏观经济环境、国家政策趋向及利率变化趋势等重点分析,判断债券市场和股票市场的相对投资价值,在债券资产与股票资产之间进行动态调整。	
业绩比较基准	本基金采用"中债综合全价指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%"作为投资业绩比较基准。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,理论上其长期平均预期风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	东方基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东方双债添利债券A类	东方双债添利债券C类
下属分级基金的交易代码	400027	400029
报告期末下属分级基金的份额总额	204,069,749.91份	72,031,609.92份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)	
	东方双债添利债券A类	东方双债添利债券C类
1.本期已实现收益	10,757,394.69	3,979,006.51
2.本期利润	14,065,357.47	5,129,683.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.0657	0.0657
4.期末基金资产净值	316,531,969.46	111,198,350.59
5.期末基金份额净值	1.5511	1.5437

注:①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方双债添利债券A类

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.12%	0.42%	4.73%	0.33%	0.39%	0.09%

东方双债添利债券C类

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.02%	0.42%	4.73%	0.33%	0.29%	0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

东方双债添利债券A类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

东方双债添利债券C类基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金基金合同于2014年9月24日生效,建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李仆(先生)	本基金基金经理、固定收益部总经理、投资决策委员会委员	2014年11月25日	-	15年	对外经济贸易大学金融学硕士,CFA,FRM,7年证券从业经历。曾任安信证券资产管理部研究员、投资经理,华西证券资产管理部投资经理。2013年3月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理助理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理。现任东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方双债添利债券型证券基金基金经理、东方添益债券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、东方永润18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。
徐昀君(先生)	本基金基金经理、固定收益部总经理助理	2014年9月24日	-	7年	对外经济贸易大学金融学硕士,CFA,FRM,7年证券从业经历。曾任安信证券资产管理部研究员、投资经理,华西证券资产管理部投资经理。2013年3月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理助理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理。现任固定收益部总经理助理,东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方双债添利债券型证券基金基金经理、东方添益债券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、东方永润18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注:①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方双债添利债券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作基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),制定了《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法,各投资组合经理在授权范围内自主决策,各投资组合共享研究平台,在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易,基金管理人执行交易系统中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

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

本报告期内,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合,未直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年四季度,宏观经济边际小幅改善但仍处低位,中采制造业景气指数连续五个月低于荣枯线。具体来看,1至11月工业企业利润总额同比下跌1.9%,单月利润总额同比增速连续六个月为负值,显示工业企业需求较为疲弱、盈利下降;11月工业增加值同比增长6.2%,房地产投资持续下行,供给侧的库存去化和产能出清仍在推进;美联储加息的靴子落地、人民币入篮SDR打开资本流动空间,人民币贬值压力不减;叠加大宗商品低迷、工业通缩压力不减等因素,我国宏观经济仍不乐观、继续探底。

在经济低位徘徊、人民币贬值的压力下,2015年四季度积极的财政政策与宽松的货币政策共同配合发力。财政政策方面,财政赤字不断加大,政策性银行发行专项金融债对重点领域"定向滴灌",由中央财政进行贴息;货币政策方面,2015年四季度央行降准50BP、降息25BP,并通过中期借贷便利操作等工具释放流动性,然而资金脱实向虚形势依然严峻。

2015年四季度债券市场收益率下行幅度较大,长端十年国债下行近40BP,十年国开债下行近60BP。10月,央行再次双降,开启低利率时代;11月,证监会宣布新股上市重启,中国证券登记结算有限公司宣布对债券回购标准券折算率进行动态调整,但对市场冲击有限;12月市场供需矛盾较大,机构到期配置热情较高,提前建仓带动收益率快速下行。

2015年四季度权益市场震荡上行,持续回暖,两融余额较九月底最低点已增长34%。中央经济工作会议的召开、货币政策放松的预期以及美联储加息靴子落地等因素助力指数上行、市场信心提振。

报告期内,权益市场有所回暖,本基金积极参与,净值上涨较快。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年10月1日起至2015年12月31日,本基金A类净值增长率为5.12%,业绩比较基准收益率为4.73%,高于业绩比较基准0.39%;本基金C类净值增长率为5.02%,业绩比较基准收益率为4.73%,高于业绩比较基准0.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年一季度,受制于春节等因素,国内宏观经济仍难大幅回升、工业生产景气度仍偏低;欧央行、美联储货币政策分化加大国际宏观经济的波动,新兴市场经济脆弱仍面临考验;2016年国内外的宏观经济不确定性将远远大于2015年。

从货币政策角度来看,在经济低迷、资本外流、企业杠杆较高的压力下,2016年宽松空间仍存,人民币贬值、外汇占款流出将不得不需要数量型工具对冲,降准空间较大。从财政政策角度来看,在我国经济尚未企稳的情况下,预计2016年财政赤字或上调至3%,地方债务置换、专项金融债、新投资项目将继续发力。

从资金角度来看,2015年的多次双降已经大幅带动资金利率下行,在央行着力建立利率走廊的背景下,预计2016年资金波动区间将有所收窄,公开市场逆回购利率仍有下行空间,仍需关注股债流动性切换。

对于2016年一季度债券市场而言,供需两旺的背景下收益率有望再下一城,国债、地方债净增量将大幅提升,银行理财、保险的再配置压力较大。考虑到国内外宏观不确定性增强、债券收益率已处低位,机构谨慎心态可能较为强烈,预计2016年债市难改震荡性格局,将重点关注利率债的波段交易价值,利率较高的地方债、高等级信用债、优质ABS等类固收产品也具有较好的投资价值。汇率风险、信用风险、政治风险将加大市场的波动。

对于2016年一季度权益市场而言,在美联储下一次加息、注册制落地实施等较大冲击前的缓冲期内,指数仍将处于震荡态势;在保险资金入市的背景下,银行体系有望贡献增量资金,低估值、现金流稳定的蓝筹板块值得关注。此外,新年伊始,密集的会议、政策将提供主题交易性机会。

未来,本基金将积极拉长债券组合久期,提升组合静态收益,同时根据市场行情变化,择机参与股票和可转债市场,选择相对强势的资产和标的参与。

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 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	78,007,329.85	12.33
	其中:股票	78,007,329.85	12.33
2	固定收益投资	506,447,251.20	80.08
	其中:债券	506,447,251.20	80.08
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	38,040,165.10	6.01
7	其他资产	9,947,762.11	1.57
8	合计	632,442,508.26	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,571.85	0.00
C	制造业	49,421,990.75	11.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,780.09	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,731,670.55	2.74
J	金融业	12,514,400.00	2.93
K	房地产业	1,356.69	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,332,963.02	1.01
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	596.90	0.00
S	综合	-	-
	合计	78,007,329.85	18.24

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000878	云南铜业	600,000	8,310,000.00	1.94
2	601099	太平洋	700,000	6,874,000.00	1.61
3	300160	秀强股份	79,666	3,190,623.30	0.75
4	300314	戴维医疗	76,800	2,613,504.00	0.61
5	000750	国海证券	200,000	2,570,000.00	0.60
6	300114	中航电测	51,265	2,568,889.15	0.60
7	300250	初灵信息	31,050	2,471,269.50	0.58
8	300340	科恒股份	67,073	2,436,091.36	0.57
9	300469	信息发展	18,420	2,262,160.20	0.53
10	300043	互动娱乐	130,074	2,235,972.06	0.52

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	26,114,400.00	6.11
	其中:政策性金融债	26,114,400.00	6.11
4	企业债券	146,627,003.20	34.28
5	企业短期融资券	281,130,000.00	65.73
6	中期票据	-	-
7	可转债	32,379,848.00	7.57
8	同业存单	-	-
9	其他	20,196,000.00	4.72
10	合计	506,447,251.20	118.40

注:"其他"为地方政府债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011599253	15首创SCP001	300,000	30,147,000.00	7.05
2	1380280	13珠海汇华债	200,000	21,448,000.00	5.01
3	1380116	13自贡高新债	200,000	21,148,000.00	4.94
4	1567002	15重庆债02	200,000	20,196,000.00	4.72
5	011599176	15闽电信SCP001	200,000	20,162,000.00	4.71

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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

5.10.2

本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,012,986.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,853,987.45
5	应收申购款	80,788.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,947,762.11

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110030	格力转债	6,485,060.00	1.52
2	128009	歌尔转债	2,109,859.40	0.49
3	113008	电气转债	8,260,200.00	1.93
4	110031	航信转债	967,308.00	0.23

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300043	互动娱乐	2,235,972.06	0.52	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	东方双债添利债券A类	东方双债添利债券C类
报告期期初基金份额总额	143,962,203.32	63,514,411.18
报告期期间基金总申购份额	160,993,525.03	53,875,158.25
减:报告期期间基金总赎回份额	100,885,978.44	45,357,959.51
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	204,069,749.91	72,031,609.92

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

一、《东方双债添利债券型证券投资基金基金合同》

二、《东方双债添利债券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、基金份额净值及其临时公告

8.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

8.3 查阅方式

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

东方基金管理有限责任公司
2016年1月20日