东方龙混合型开放式证券投资基金

2019 第一季度 报告

2019年3月31日

基金管理人:东方基金管理有限责任公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十九日

§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2019年4月18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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方龙混合
基金主代码	400001
交易代码	400001
前端交易代码	400001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年11月25日
报告期末基金份额总额	383,221,868.33份
投资目标	分享中国经济和资本市场的高速增长,努力为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。
投资策略	本基金的投资管理由自上而下的资产配置、积极风格管理和自下而上的个股(包括债券)选择组成。本基金将资产配置、基金风格管理和个股选择都建立在全面、深入而有效的研究的基础上。研究贯穿于基金投资管理的每一个环节。
业绩比较基准	中信标普300成长指数*30% +中信标普300价值指数*45% +中证综合债指数*25%。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的中等风险品种,其风险收益特征介于单纯的股票型基金、单纯的债券型基金与单纯的货币市场基金之间,同时其股票组合部分的风险收益特征也介于完全成长型股票组合与完全价值型股票组合之间。
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(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	-1,882,751.93
2.本期利润	63,355,205.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.1638
4.期末基金资产净值	357,066,174.90
5.期末基金份额净值	0.9317

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	21.33%	1.23%	20.30%	1.11%	1.03%	0.12%

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

§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		
朱晓栋	本基金基金经理、权益投资部副总经理	2015年1月1日	2019年3月20日	10年	权益投资部副总经理,对外经济贸易大学经济学硕士,10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、东方多策略灵活配置混合型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、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理。
许文波	本基金基金经理、公司总经理助理、权益投资总监、量化投资部总经理、投资决策委员会委员	2019年1月2日	-	18年	公司总经理助理、权益投资总监、量化投资部总经理、投资决策委员会委员。吉林大学工商管理硕士,18年投资从业经历。曾任新华证券有限责任公司投资顾问部分析师;东北证券股份有限公司资产管理分公司投资管理部投资经理、部门经理;德邦基金管理有限公司基金经理、投资研究部总经理。2018年4月加盟东方基金管理有限责任公司,现任东方精选混合型开放式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、东方龙混合型开放式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、《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,由于国内金融数据较好以及中美贸易谈判进展顺利等利好下,市场出现较大幅度反弹。二级市场的主要指数出现普涨,上证综指、沪深300和创业板等指数涨幅均超过20%。报告期内,本基金逐步调整去年底低仓位的防御策略,开始逐步提升仓位,参与市场反弹。在行业配置上,一方面提升持仓集中度,增加在优质消费个股上的配置;另一方面增持成长方向的持仓比例。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2019年1月1日起至2019年3月31日,本基金净值增长率为21.33%,业绩比较基准收益率为20.30%,高于业绩比较基准1.03%。

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 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	293,507,549.99	81.23
	其中:股票	293,507,549.99	81.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	58,755,208.19	16.26
	其中:债券	58,755,208.19	16.26
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	6,599,916.40	1.83
8	其他资产	2,482,513.29	0.69
9	合计	361,345,187.87	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	15,541,285.94	4.35
B	采矿业	-	-
C	制造业	216,804,756.22	60.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,847,000.00	0.80
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	504,249.85	0.14
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	9,634,615.94	2.70
J	金融业	26,774,877.75	7.50
K	房地产业	18,537,000.00	5.19
L	租赁和商务服务业	2,807,615.04	0.79
M	科学研究和技术服务业	56,149.25	0.02
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	293,507,549.99	82.20

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	600519	贵州茅台	39,000	33,305,610.00	9.33
2	002372	伟星新材	850,035	17,136,705.60	4.80
3	000858	五 粮 液	180,000	17,100,000.00	4.79
4	603288	海天味业	169,905	14,730,763.50	4.13
5	300124	汇川技术	500,000	13,115,000.00	3.67
6	600436	片仔癀	105,004	12,064,959.60	3.38
7	002714	牧原股份	179,920	11,390,735.20	3.19
8	600340	华夏幸福	350,000	10,857,000.00	3.04
9	002508	老板电器	329,970	10,625,034.00	2.98
10	000333	美的集团	200,000	9,746,000.00	2.73

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	20,000,000.00	5.60
	其中:政策性金融债	20,000,000.00	5.60
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	38,755,208.19	10.85
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	58,755,208.19	16.45

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	190201	19国开01	200,000	20,000,000.00	5.60
2	113011	光大转债	60,000	6,892,200.00	1.93
3	113008	电气转债	40,000	4,864,800.00	1.36
4	113013	国君转债	40,000	4,736,400.00	1.33
5	127010	平银转债	34,997	4,141,195.01	1.16

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金所持有的五粮液(000858.SZ)于2018年7月14日和8月28日分别公告公司监事会主席余铭书及宜宾市国有资产经营有限公司董事长张辉(其现任公司第五届董事会董事)正接受纪律审查和监察调查,

宜宾五粮液股份有限公司公告上述事项不会对本公司生产经营和长远发展产生影响。

同时五粮液(000858.SZ)于2015年6月3日公告高管违规减持,公司知悉此事后,高度重视,及时了解相关情况,对高管违规减持股票的行为进行了严肃的批评教育,并责成其进行深刻书面检讨。

本基金决策依据及投资程序:

(1)研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究,形成有关的各类报告,为本基金的投资管理提供决策依据。

(2)投资决策委员会定期召开会议,讨论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范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

(3)基金经理根据投资决策委员会的决议,参考上述报告,并结合自身的分析判断,形成基金投资计划,主要包括行业配置和投资组合管理。

(4)交易部依据基金经理的指令,制定交易策略,统一进行具体品种的交易;基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

(5)投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施,监察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资五粮液主要基于以下原因:公司作为白酒行业龙头,本轮白酒行业复苏情况下受益。公司全面改革紧扣行业趋势,产品端以新品升级换代为载体,在信息化建设的基础上导入控盘分利模式、强化终端渠道建设在大数据赋能下导入控盘分利机制,强化以专卖店为代表的终端建设,管理下沉,并向真正做好消费者培育的经销商和终端以政策倾斜。同时品牌重塑,坚决清理损耗品牌力的高仿产品,推出高端五粮液,聚焦新品经典五粮液,建立基于窖龄的品牌价值认知体系。多项举措并行体现管理层改革信心。伴随消费升级趋势,公司有望量价齐升。目前估值合理,存在投资价值。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	139,108.19
2	应收证券清算款	2,127,114.87
3	应收股利	-
4	应收利息	163,461.21
5	应收申购款	52,829.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,482,513.29

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	6,892,200.00	1.93
2	113008	电气转债	4,864,800.00	1.36
3	113013	国君转债	4,736,400.00	1.33
4	128035	大族转债	3,297,620.40	0.92
5	113017	吉视转债	2,777,750.00	0.78
6	113511	千禾转债	2,220,200.00	0.62
7	110041	蒙电转债	1,663,500.00	0.47
8	113009	广汽转债	1,102,600.00	0.31
9	123003	蓝思转债	1,072,092.78	0.30
10	127005	长证转债	574,950.00	0.16

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300124	汇川技术	13,115,000.00	3.67	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	389,117,966.74
报告期期间基金总申购份额	7,974,861.43
减:报告期期间基金总赎回份额	13,870,959.84
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	383,221,868.33

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

一、《东方龙混合型开放式证券投资基金基金合同》

二、《东方龙混合型开放式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

9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

9.3 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
2019年4月19日

东方区域发展混合型证券投资基金

2019 第一季度 报告

2019年3月31日

基金管理人:东方基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十九日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月18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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方区域发展混合
基金主代码	001614
交易代码	001614
前端交易代码	001614
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月7日
报告期末基金份额总额	32,464,193.85份
投资目标	在严格控制风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	在大类资产配置的基础上,本基金将通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求状况、信用风险状况等因素进行综合分析,在目标久期控制及期限结构配置基础上,采取积极投资策略,确定类属资产的最优配置比例。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×中债总全价指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	-59,549.26
2.本期利润	7,268,478.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.1928
4.期末基金资产净值	28,670,113.72
5.期末基金份额净值	0.8831

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。

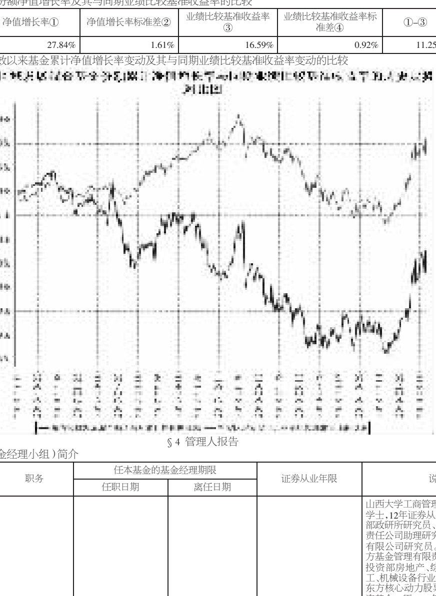
②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	27.84%	1.61%	16.59%	0.92%	11.25%	0.69%

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



§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		
薛子徵(先生)	本基金基金经理	2016年9月7日	-	12年	山西大学工商管理、应用心理学专业学士,12年证券从业经历。曾任中宣部政研所研究员、中信基金管理有限责任公司助理研究员、华夏基金管理有限公司研究员。2009年7月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任权益投资部房地产、综合、汽车、国防军工、机械设备行业研究员、投资经理、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、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理、东方大健康混合型证券投资基金基金经理、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金(自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,现任东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方新价值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、东方周期优选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、《东方区域发展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作基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年一季度,美国加息进度放缓、缩表提前结束,全球流动性出现回暖;国内宏观经济虽仍处于下滑状态,但其中不乏超预期亮点,一方面2018年下半年以来的宽货币、宽信用政策开始传导到实体,一二线核心城市房地产销售量价齐升,带动下游消费行业预期回暖。另一方面,中美贸易摩擦缓和,制造业订单出现一定幅度好转,而减税降费政策力度超出市场预期,进一步推升市场情绪。

一季度SW各行业全面上涨,其中计算机上涨48.46%位居第一,农业受到非瘟疫情超预期带动上涨48.42%位居第二,食品饮料43.5%位居第三。而银行因市场对于息差、不良的双重担忧,涨幅仅16.8%涨幅垫底,其次为公用事业17.8%、建筑装饰18.28%。

此前我们已经对一季度市场的反弹有所预期,因此在本季度提升仓位,同时行业层面集中配置了受益于宽信用、宽货币的地产、券商板块,以及受益与停飞影响的航空板块,较好的享受了一季度市场的上涨行情。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2019年1月1日起至2019年3月31日,本基金净值增长率为27.84%,业绩比较基准收益率为16.59%,高于业绩比较基准11.25%。

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,受基金份额持有人赎回等影响,本基金存在基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况,本基金管理人已将此情况上报中国证监会并拟采取持续营销、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等措施。

§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	23,974,860.95	82.98
	其中:股票	23,974,860.95	82.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,000,300.00	10.38
	其中:债券	3,000,300.00	10.38
	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	1,796,635.53	6.22
8	其他资产	121,755.51	0.42
9	合计	28,893,551.99	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	-	-
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	-	-
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	12,000,220.00	41.86
K	房地产业	11,974,640.95	41.77
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	23,974,860.95	83.62

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	600036	招商银行	75,000	2,544,000.00	8.87
2	001979	招商蛇口	110,000	2,534,400.00	8.84
3	601318	中国平安	30,000	2,313,000.00	8.07
4	600048	保利地产	150,000	2,136,000.00	7.45
5	601939	建设银行	240,000	1,668,000.00	5.82
6	600030	中信证券	67,000	1,660,260.00	5.79
7	000776	广发证券	100,000	1,617,000.00	5.64
8	000732	泰禾集团	84,000	1,590,960.00	5.55
9	000002	万 科A	50,000	1,536,000.00	5.36
10	600383	金地集团	110,000	1,512,500.00	5.28

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	3,000,300.00	10.46
	其中:政策性金融债	3,000,300.00	10.46
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,000,300.00	10.46

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	018005	国开1701	30,000	3,000,300.00	10.46
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金所持有招商银行(600036.SH)于2018年5月4日受到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚。

招商银行的主要违法违规事实:

(一)内控管理严重违反审慎经营规则;

(二)违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款;

(三)同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保;

(四)销售同业非保本理财产品时违规承诺保本;

(五)违规将票据贴现资金直接转回出票人账户;

(六)为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保;

(七)未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目;

(八)高管人员在获得任职资格核准前履职;

(九)未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务;

(十)未严格审查贸易背景真实性开立信用证;

(十一)违规签订保本合同销售同业非保本理财产品;

(十二)非真实转让信贷资产;

(十三)违规向典当行发放贷款;

(十四)违规向关系人发放信用贷款。

基于上述事实,招商银行受到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚决定:罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。

本基金所持有的招商蛇口(001979.SZ)于2018年3月27日和8月21日公告多起民事诉讼案件,主要涉及合同纠纷、欠款纠纷和债权人利益纠纷等。目前3月27日公告民事诉讼案件已接受审理并做出判决。8月21日公告的多起民事案件已分别由北京市第二中级人民法院和深圳前海合作区人民法院受理,案件正在审理过程中。

招商局蛇口工业区控股股份有限公司公告以上民事诉讼案件不会对招商局蛇口工业区控股股份有限公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金决策依据及投资程序:

(1)研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究,形成有关的各类报告,为本基金的投资管理提供决策依据。

(2)投资决策委员会定期召开会议,讨论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范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

(3)基金经理根据投资决策委员会的决议,参考上述报告,并结合自身的分析判断,形成基金投资计划,主要包括行业配置和投资组合管理。

(4)交易部依据基金经理的指令,制定交易策略,统一进行具体品种的交易;基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

(5)投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施,监察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资招商银行主要基于以下原因:招商银行股份有限公司是中国境内第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行、国家从体制外推动银行业改革的第一家试点银行,也是一家拥有商业银行、金融租赁、基金管理、人寿保险、境外投行等金融牌照的银行集团。近年来,公司聚焦移动优先策略,拥抱金融科技(Fintech),率先推出闪电贷、刷脸取款、"一闪通"支付等创新服务,招商银行手机银行、掌上生活两大App已成行业翘楚,月活量均稳居金融行业前十。经过多年创新发展,招商银行部分业务领域已成为国内商业银行的标杆,连续多年获得境内外权威媒体评选的"中国最佳零售银行"、"中国最佳私人银行"、"中国最佳交易银行"等殊荣。

本基金投资招商蛇口主要基于以下原因:公司是招商局集团旗下城市综合开发运营板块的旗舰企业,是招商局集团在国内重要的核心资产整合及业务协同平台。公司致力于成为"中国领先的城市及园区综合开发和运营服务商",确立了"前港-中区-后城"的开发模式,以"产、网、融、城一体化发展"为业务抓手,协同园区开发运营、社区开发运营、邮轮建设运营等三大业务,配套提供多元化的、覆盖全生命周期的产品与服务。公司作为A股重要的房地产龙头公司,在估值较低的情况下,具备一定的投资机会。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,512.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	112,171.65
5	应收申购款	5,071.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	121,755.51

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	42,443,644.09
报告期期间基金总申购份额	1,776,513.37
减:报告期期间基金总赎回份额	11,755,963.61
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	32,464,193.85

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

一、《东方区域发展混合型证券投资基金基金合同》

二、《东方区域发展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、基金份额净值及其临时公告

9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

9.3 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
2019年4月19日

东方金账簿货币市场证券投资基金

2019 第一季度 报告

2019年3月31日

基金管理人:东方基金管理有限责任公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月十九日

§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2019年4月18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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方金账簿货币	
基金主代码	400005	
交易代码	400005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年8月2日	
报告期末基金份额总额	6,689,617,423.42份	
投资目标	在强调本金安全性、资产充分流动性的前提下,追求稳定的当期收益。	
投资策略	本基金以价值分析为基础,以主动式的科学投资管理为手段,把握宏观经济走向与微观经济脉搏,通过以剩余期限为核心的资产配置,充分考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征,追求基金资产稳定的当期收益。	
业绩比较基准	银行税后活期利率	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
基金管理人	东方基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东方金账簿货币A	东方金账簿货币B
下属分级基金的交易代码	400005	400006
报告期末下属分级基金的份额总额	190,237,038.34份	6,499,380,385.08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(2019年1月1日 - 2019年3月31日)	
	东方金账簿货币A	东方金账簿货币B
1. 本期已实现收益	1,293,807.08	42,018,430.09
2.本期利润	1,293,807.08	42,018,430.09
3.期末基金资产净值	190,237,038.34	6,499,380,385.08

注:①本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

②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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方金账簿货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6580%	0.0031%	0.0863%	0.0000%	0.5717%	0.0031%

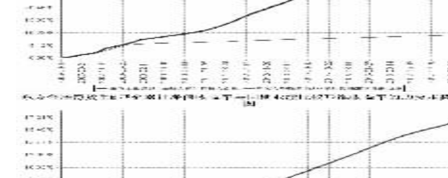
注:本基金每日分配收益,按月结转份额。

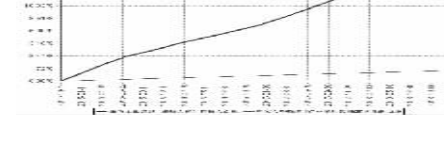
东方金账簿货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7176%	0.0031%	0.0863%	0.0000%	0.6313%	0.0031%

注:本基金每日分配收益,按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





§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		
姚航(女士)	本基金基金经理、固定收益投资部副总经理、投资决策委员会委员	2013年9月25日	2019年3月6日	15年	固定收益投资部副总经理,投资决策委员会委员,中国人民大学工商管理硕士,15年证券从业经历。曾就职于嘉实基金管理有限公司运营部。2010年10月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任债券交易员、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金(于2017年5月11日起转型为东方成长收益平衡混合型证券投资基金)基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金(于2017年9月13日起转型为东方民丰回报赢安混合型证券投资基金)基金经理、东方成长收益平衡混合型证券投资基金(于2018年1月17日转型为东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金)基金经理、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方成长收益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、东方金元宝货币市场基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理。
周薇(女士)	本基金基金经理	2019年3月1日	-	10年	中国人民银行研究生部金融学博士,10年证券从业经历,曾任中国银行总行外汇期权投资经理。2012年7月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任固定收益部债券研究员、投资经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场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(于2017年8月23日起转型为东方永润债券型证券投资基金)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、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方永润债券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,现任东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方新价值混合型证券投资基金基金经理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方永熙18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理、东方金元宝货币市场基金基金经理、东方金账簿货币市场基金基金经理。

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、《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

从货币市场来看,18年12月末可能是全年最好的配置窗口。3m的AAA存单在18年12月26日触及3.55的高点,之后一路下行:1月整体在2.7-2.9的区间,较好的配置窗口期为月中和月末。2月整体在2.6-2.8的区间,春节后资金整体偏宽松因此一路下行,仅在2月26日超预期资金紧张的冲击下触及2.8。3月整体在2.6-2.8,仅在3月18日触及2.82的高点,这是因为货币基金在季末均缩短了久期,以致Q1的季末资金供给充足并没有出现预期汇总的紧张。

报告期内,本基金规模变化较大,实施流动性管理新规后月末、季末流动性管理加大,配置方面在关键性的时点重点配置了三个月、六个月的存款及cd,拉长组合剩余期限,同时增配了一定比例的优质资产支持证券,增厚了组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2019年1月1日起至2019年3月31日,本基金A类净值增长率为0.6580%,业绩比较基准收益率为0.0863%,高于业绩比较基准0.5717%;本基金B类净值增长率为0.7176%,业绩比较基准收益率为0.0863%,高于业绩比较基准0.6313%。

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 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	固定收益投资	4,162,888,253.85	58.75
	其中:债券	4,042,888,253.85	57.06
	资产支持证券	120,000,000.00	1.69
2	买入返售金融资产	2,313,536,630.29	32.65
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	600,495,615.35	8.48
4	其他资产	8,396,794.21	0.12
5	合计	7,085,317,293.70	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		4.42
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	379,999,610.00	5.68
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	61
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	64
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	64.58	5.68
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	8.20	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	16.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	1.03	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	15.72	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	105.79	5.68

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(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	400,017,163.39	5.98
	其中:政策性金融债	400,017,163.39	5.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	310,014,993.11	4.63
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,332,856,097.35	49.82
8	其他	-	-
9	合计	4,042,888,253.85	60.44
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111916079	19上海银行CD079	3,000,000	299,411,057.12	4.48
1	111921099	19渤海银行CD099	3,000,000	299,411,057.12	4.48
2	111994279	19盛京银行CD137	3,000,000	299,409,942.60	4.48
3	111994264	19天津银行CD033	3,000,000	299,405,247.32	4.48
4	111872192	18东莞农村商业银行CD134	3,000,000	298,019,437.38	4.45
5	190201	19国开01	2,600,000	260,059,616.75	3.89
6	111991134	19南京银行CD014	2,000,000	199,553,711.16	2.98
7	111812098	18北京银行CD098	1,300,000	129,747,219.30	1.94
8	011900316	19南航股SCP002	1,000,000	99,896,512.61	1.49
9	111821155	18渤海银行CD155	1,000,000	99,806,942.41	1.49
10	111994289	19桂林银行CD046	1,000,000	99,797,507.43	1.49

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1320%
报告期内偏离度的最低值	0.0003%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0732%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	156126	国花01A	500,000	50,000,000.00	0.75
2	156081	18建花3A	500,000	50,000,000.00	0.75
3	149920	18花呗6A	200,000	20,000,000.00	0.30
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

5.9.2 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

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	8,258,197.21
4	应收申购款	138,597.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	8,396,794.21

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	东方金账簿货币A	东方金账簿货币B
报告期期初基金份额总额	201,171,474.03	3,863,030,373.74
报告期期间基金总申购份额	118,657,339.76	8,419,099,693.49
报告期期间基金总赎回份额	129,591,775.45	5,782,749,682.15
报告期期末基金份额总额	190,237,038.34	6,499,380,385.08

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2019年1月4日	40,000,000.00	40,000,000.00	0.00%
合计			40,000,000.00	40,000,000.00	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

一、《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》

二、《东方金账簿货币市场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

9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

9.3 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
2019年4月19日