东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金

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	东方永兴18个月定期开放债券
基金主代码	003324
交易代码	003324
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月2日
报告期末基金份额总额	185,081,462.84份
投资目标	本基金在积极投资,有效控制风险的前提下,追求基金资产的长期、稳定增值,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金通过对我国宏观经济运行环境、货币政策等相关政策的深入分析,判断我国中短期利率走势,债券市场预期风险水平和相对收益率,结合本基金定期开放式运作的特点,在基金的封闭期与开放期,本基金采用不同的投资策略。
业绩比较基准	同期一年期银行定期存款基准利率x1.5
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	东方永兴18个月定期开放债券A	东方永兴18个月定期开放债券C
下属分级基金的交易代码	003324	003325
报告期末下属分级基金的份额总额	175,630,372.01份	9,451,090.83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)	
	东方永兴18个月定期开放债券A	东方永兴18个月定期开放债券C
1.本期已实现收益	3,851,690.52	194,761.90
2.本期利润	4,087,423.24	207,373.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.0233	0.0219
4.期末基金资产净值	201,998,668.60	10,762,424.27
5.期末基金份额净值	1.1501	1.1387

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

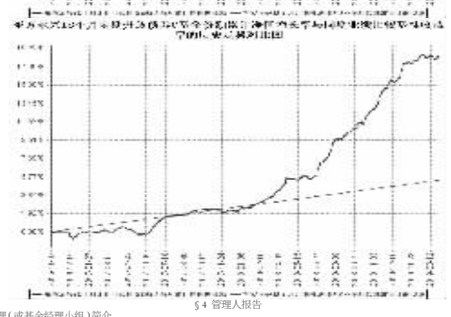
东方永兴18个月定期开放债券A

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%	0.09%	0.55%	0.01%	1.51%	0.08%

东方永兴18个月定期开放债券C

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	1.96%	0.09%	0.55%	0.01%	1.41%	0.08%

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		
吴萍萍(女士)	本基金基金经理	2016年11月3日	-	8年	中国人民大学应用经济学硕士,8年证券从业经历,曾任安信证券投资组资金交易员、民生加银基金管理有限公司专户投资经理,2015年11月加盟东方基金管理有限责任公司,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、东方赚钱纯债债券型证券投资基金基金经理、东方合宝保本混合型证券投资基金基金经理、东方赚钱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、东方永春纯债1年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、《东方永兴18个月定期开放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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年一季度,宏观经济开局平稳,社融信贷数据较超预期,虽有开门红季节性因素影响,但地方债发行提速、民企纾困积极推进、宽信用政策逐步出现效果,社融同比基本已见底;受基建投资和房地产投资的小幅拉动,固定资产投资增速有所恢复,中资生产动能等高频指标也有所改善,通胀翘尾因素逐渐显现,海外市场方面,全球经济增速整体放缓,以美联储为代表的全球多家央行转向“鸽派”倾向,叠加中美贸易摩擦的缓和,市场风险偏好有所提升。

从债券市场来看,推动2018年债券收益率下行的两大因素都边际有所改变,一方面2018年信贷市场体现为信用收缩、融资渠道收窄,2019年以来被前国内政策逆周期调节,信用扩张边际改善,另一方面中美贸易摩擦及美联储加息等海外因素也出现逆转,受此影响,债券收益率先下后上,年初至春节时债券收益率延续下行态势,10年期国债和10年期国开债最低下行至3.04%、3.49%,节后整体震荡,风险偏好有所回升,报告期内,本基金持仓主要为优质城投及龙头产业债,并择时参与了长端利率波段操作,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2.06%,业绩比较基准收益率为0.55%,高于业绩比较基准1.51%;本基金C类净值增长率为1.96%,业绩比较基准收益率为0.55%,高于业绩比较基准1.41%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	323,050,211.80	95.42
	其中:债券	323,050,211.80	95.42
	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	9,762,432.29	2.88
8	其他资产	5,758,093.60	1.70
9	合计	338,570,737.69	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	9,960,000.00	4.68
	其中:政策性金融债	9,960,000.00	4.68
4	企业债券	243,675,211.80	114.53
5	企业短期融资券	20,128,000.00	9.46
6	中期票据	49,287,000.00	23.17
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	323,050,211.80	151.84

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	123046	16宁杰01	200,000	20,120,000.00	9.46
2	136573	16希投债	174,000	17,353,020.00	8.16
3	122333	14富宝债	170,000	17,187,000.00	8.08
4	136377	16奉坡债	160,000	15,984,000.00	7.51
5	122436	15远洋02	150,000	15,019,500.00	7.06

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本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金所持有16海投债(136685),发行人厦门海沧投资集团有限公司(以下简称“公司”),受到行政处罚。于2019年1月29日,公司收到中国证券监督管理委员会厦门监管局作出的《监管关注函》(厦证监函【2019】44号),主要是厦门监管局关注到公司近期拟进行资产重组导致业务、资产发生较大变化,鉴此提出监管意见。

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,并根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16海投债(136685)主要基于以下原因:

公司的贸易业务主要由其子公司厦门海投经济贸易有限公司经营管理,经贸公司曾获得“2010~2011年度厦门市进出口百强企业(2010年排名第27名,2011年排名第57名)”、“2010~2011年度厦门市进口大户(2010年排名第12名,2011年排名第19名)”、“2009~2012年度厦门市守合同重信用企业”公司经营的业务销量逐年增加,2013年获得福建省国有钢贸企业十强,公司塑料、废纸等再生资源进口量位居连续多年位居全省第一。2013年公司房地产销售面积28.40万平方米,在海沧区排名首位,在厦门市排名第5位。2014年公司房地产销售面积18.1万平方米(不含水云湾安置房38.35万平方米),在海沧区排名首位,在厦门市排名第7位(加上水云湾项目,在厦门市排名第12名)。公司自设立以来,承担了大量的政府工程,经多年发展,公司经营规模和实力不断壮大,在工程施工与综合配套建设方面的竞争力已经形成。

16海投债(136685)的债项评级为AA+,主体评级为AA+,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。

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。

5.10.2 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

本基金本报告期内未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	61,956.71
2	应收证券清算款	71,549.97
3	应收股利	-
4	应收利息	5,624,586.92
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,758,093.60

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

项目	东方永兴18个月定期开放债券A	东方永兴18个月定期开放债券C
报告期期初基金份额总额	175,630,372.01	9,451,090.83
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	175,630,372.01	9,451,090.83

§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 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190101 - 20190331	149,999,000.00	-	-	149,999,000.00	81.04%
	-	-	-	-	-	-	-
个人							
产品持有风险							

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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

一、《东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》

二、《东方永兴18个月定期开放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

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

东方主题精选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	东方主题精选混合
基金主代码	400032
交易代码	400032
前端交易代码	400032
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月23日
报告期末基金份额总额	183,546,251.62份
投资目标	通过深入扎实的研究,精选投资主题,把握中国经济成长和改革带来的投资机会,力争实现基金的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资的股票资产占基金资产的比例为40%-95%。在符合相关法律法规规定和基金合同约定的投资比例限制基础上,本基金采用主题投资策略,通过对我国经济发展过程中出现的主题类投资机会进行挖掘。投资于符合当期经济发展目标且具有可持续发展前景的优秀上市公司,在力争实现基金长期稳定增值的基础上,提高基金投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率x60%+中债总全价指数收益率x40%
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	7,721,363.20
2.本期利润	20,234,294.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.1087
4.期末基金资产净值	110,579,471.10
5.期末基金份额净值	0.6025

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。

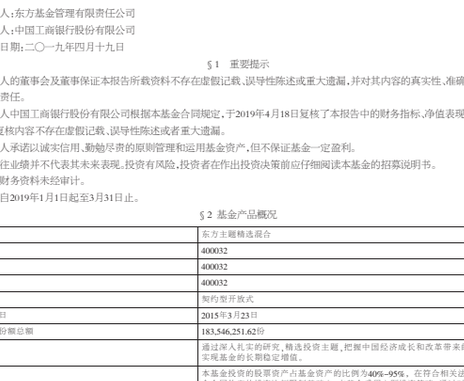
②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	22.06%	1.57%	16.59%	0.92%	5.47%	0.65%

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		
王晓伟(先生)	本基金基金经理	2016年11月2日	2019年1月2日	16年	中央财经大学工商管理硕士,16年证券从业经历,曾任东北证券北京三里河东路营业部系统管理员、东方基金管理有限责任公司系统管理员、交易员、中国国际金融有限公司销售交易部交易员。2013年4月加入东方基金管理有限责任公司,曾任交易部总经理、专户投资部总经理、投资经理、东方策略保本混合型证券投资基金基金经理、东方主题精选混合型证券投资基金基金经理。
蒋茜(先生)	本基金基金经理、权益投资部总经理、投资决策委员会委员	2019年1月2日	-	9年	权益投资部总经理,投资决策委员会委员,清华大学工商管理硕士,9年证券从业经历,曾任GCW Consulting商业分析师、中信证券高级经理、天安财产保险股份有限公司研究总监、渤海人寿保险股份有限公司投资总监。2017年5月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任研究部总经理,现任东方文体产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方主题精选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、《东方主题精选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

报告期内,由于国内金融数据转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,在行业配置方向以金融+科技为主线,重点配置成长方向的行业龙头,看好科创板映射带来的投资机会,重点配置方向包括券商、人工智能、5G、工业物联网、云计算和创新药等。

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22.06%,业绩比较基准收益率为16.59%,高于业绩比较基准5.47%。

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	96,002,700.22	86.13
	其中:股票	96,002,700.22	86.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	7,860,941.80	7.05
8	其他资产	7,594,367.28	6.81
9	合计	111,458,009.30	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	1,624,000.00	1.47
B	采矿业	-	-
C	制造业	35,522,026.72	32.12
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	15,317,248.00	13.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,039,564.50	34.40
J	金融业	5,499,861.00	4.97
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	96,002,700.22	86.82

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	600570	恒生电子	76,500	6,698,340.00	6.06
2	300271	华宇软件	310,000	6,593,700.00	5.96
3	002475	立讯精密	255,000	6,324,000.00	5.72
4	601021	春秋航空	120,000	4,872,000.00	4.41
5	601111	中国国航	397,200	4,305,648.00	3.89
6	600029	南方航空	480,000	4,104,000.00	3.71
7	600845	宝信软件	99,909	3,281,011.56	2.97
8	002410	广联达	110,000	3,279,100.00	2.97
9	002405	四维图新	144,000	3,265,920.00	2.95
10	000977	浪潮信息	130,000	3,250,000.00	2.94

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.11.2 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	123,659.16
2	应收证券清算款	7,419,620.20
3	应收股利	-
4	应收利息	2,501.56
5	应收申购款	48,586.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,594,367.28

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

项目	187,702,938.60
报告期期初基金份额总额	187,702,938.60
报告期期间基金总申购份额	2,634,595.27
减:报告期期间基金总赎回份额	6,791,282.25
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	183,546,251.62

§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、《东方主题精选混合型证券投资基金基金合同》

二、《东方主题精选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

东方臻选纯债债券型证券投资基金

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:浙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。

基金托管人浙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	东方臻选纯债债券
基金主代码	006212
交易代码	006212
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年8月24日
报告期末基金份额总额	998,524,450.52份
投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金根据宏观经济运行情况、货币政策走向、金融市场运行趋势和市场利率水平变化特点等进行分析研究,优选具有投资价值的个券,在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,实现基金的持续稳定增值。
业绩比较基准	中债总全价指数收益率
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	浙商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	东方臻选纯债债券A	东方臻选纯债债券C
下属分级基金的交易代码	006212	006213
报告期末下属分级基金的份额总额	997,104,252.64份	1,420,197.88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

|