

东方臻享纯债债券型证券投资基金

2018年第一季度报告

报告期内,该纯债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与交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本报告期内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,未发现本基金有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对手方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

1季度债券市场收益率整体呈现小牛市行情。国开10年从1月初的4.87%上行至1月中旬的5.12%,然后逐步下行,2月末收益率至4.65%,下行幅度自高点接近50bp,是一段不稳定的小牛市行情。自去年年初提前通过调整持仓,缩短1-3年期期限的持仓,市场整体收益率下降,本基金收益也随之下降。随着利率下行,整体资产收益以及公开市场流动性压力都一定的预期有所显现,个别两会之后再次加仓,央行开常备借贷,流动性波动性超出市场预期,且午后更多地通过公开市场投放流动性,整体风格较去年明显改变,因此无论中短还是各种金融资产都被认为是具备较好的市场条件。当然,1季度行情波动较大,固收资产和存款类资产,对于本基金来说,市场整体流动性压力都一定的预期有所显现,个别两会之后再次加仓,央行开常备借贷,流动性波动性超出市场预期,且午后更多地通过公开市场投放流动性,整体风格较去年明显改变,因此无论中短还是各种金融资产都被认为是具备较好的市场条件。

本报告期内,本基金规模稳步增长,净值平稳增长,操作上主要为了进行了一定规模的利率择机操作,并于春节期间进行了加仓操作,获得了一定的市场利润和收益。

4.5 报告期内基金业绩比较基准

2018年11月1日起至2018年3月31日,本基金净值增长率为2.43%,业绩比较基准收益率为1.21%,高于业绩比较基准1.22%。本基金6个月的净值增长率为2.43%,业绩比较基准收益率为1.21%,高于业绩比较基准1.19%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金不存在在任何一个工作日基金资产净值低于人民币二亿元或基金资产净值低于人民币50%的情况。

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	-	-
2	其中:股票	-	-
3	基金投资	-	-
4	固定收益投资	387,322,716.20	97.23
5	其中:债券	387,322,716.20	97.23
6	资产支持证券	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	金融衍生品投资	-	-
9	买入返售金融资产	-	-
10	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
11	银行存款和结算备付金合计	443,719.62	0.12
12	其他资产	9,353,616.97	2.35
13	合计	387,120,052.79	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	88,112,180.00	33.04
4	其中:政策性金融债	88,112,180.00	33.04
5	企业债券	100,188,026.20	37.20
6	企业短期融资券	126,025,509.99	46.77
7	中期票据	39,070,000.00	14.59
8	资产支持证券	-	-
9	其他	-	-
10	合计	387,322,716.20	134.00

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	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160003	中央国债承销团160003	121,284,762.88	86.00
2	160007	中央国债承销团160007	121,284,762.88	86.00
3	160008	中央国债承销团160008	-	-
4	160009	中央国债承销团160009	10,004,000.00	7.09
5	160010	中央国债承销团160010	10,004,000.00	7.09
6	160011	中央国债承销团160011	-	-
7	160012	中央国债承销团160012	-	-
8	160013	中央国债承销团160013	-	-
9	160014	中央国债承销团160014	-	-
10	160015	中央国债承销团160015	-	-

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 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.3 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.4 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.5 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.6 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.7 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.8 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.9 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.10 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.11 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.12 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.13 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.14 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.15 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.16 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.17 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.18 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.19 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.20 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.21 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.22 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.23 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.24 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.25 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.26 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.27 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.28 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.29 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.30 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.31 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.32 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.33 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.34 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.35 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.36 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.37 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.38 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.39 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.40 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.41 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.42 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.43 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.44 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.45 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.46 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.47 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.48 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.49 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.50 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.51 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.52 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.53 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.54 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.55 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.56 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.57 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.58 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.59 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.60 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.61 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.62 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.63 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.64 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.65 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.66 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.67 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.68 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.69 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.70 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.71 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.72 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.73 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.74 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.75 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.76 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.77 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.78 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.79 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.80 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.81 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.82 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.83 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.84 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.85 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.86 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.87 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.88 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.89 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.90 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.91 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.92 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.93 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.94 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.95 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.96 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.97 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.98 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.99 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.100 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.101 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.102 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.103 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.104 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.105 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.106 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.107 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.108 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.109 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.110 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.111 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.112 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.113 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.114 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.115 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.116 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.117 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.118 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.119 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.120 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.121 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.122 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.123 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.124 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.125 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.126 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.127 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.128 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.129 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.130 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。

5.11.131 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有投资超出基金合同规定投资范围之外的股票。