

东方利群混合型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

收益率变动的比较



利群混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)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财产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大的利益,现将报告期内基金的投资策略和运作情况报告如下。

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》。

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度债券市场整体是窄幅震荡行情,继续呈现一定的结构分化,到期率短端的信用行情优于到期率短端的信用行情,特别是对AA级以下的债券来说,5年期走勢明显弱于2年期走勢,AA+级别亦呈现同样的形态。国债10年期从7月初的4.21%下行至7月下旬的4.05%,然后高位震荡至9月下旬的4.29%,高低点之间在24bp的波动,整体“宽信用”格局无碍。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2018年7月1日起至2018年9月30日,本基金A类净值增长率为-0.19%,业绩比较基准收益率为0.33%,低于业绩比较基准2.24%。本基金C类净值增长率为-0.26%,业绩比较基准收益率为1.45%,高于业绩比较基准0.81%。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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 报告期内前十名证券的发行主体在本报告期内未发生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 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

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.6 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

Table with 2 columns: 报告期末基金管理人持有本基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金份额占基金总份额比例

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。

8.1 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

本报告期末本基金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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 备查文件目录

- (一)东方利群混合型发起式证券投资基金基金合同
(二)东方利群混合型发起式证券投资基金托管协议
(三)东方利群混合型发起式证券投资基金招募说明书
(四)基金管理人公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他相关信息
(五)基金管理人办公场所

9.2 查阅方式

上述备查文件存放在本基金管理人办公场所。

9.3 查阅费用

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印件或复印件。

9.4 联系方式

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 2018年10月25日

东方精选混合型开放式证券投资基金

2018年第三季度报告

收益率变动的比较



本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》。

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》。

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,本基金有大规模赎回,债券部分进行了卖出操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2018年7月1日起至2018年9月30日,本基金A类净值增长率为-6.57%,业绩比较基准收益率为-3.33%,高于业绩比较基准3.24%。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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 报告期内前十名证券的发行主体在本报告期内未发生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 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

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.6 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

Table with 2 columns: 报告期末基金管理人持有本基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金份额占基金总份额比例

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。

8.1 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

本报告期末本基金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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 备查文件目录

- (一)东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同
(二)东方精选混合型开放式证券投资基金托管协议
(三)东方精选混合型开放式证券投资基金招募说明书
(四)基金管理人公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他相关信息
(五)基金管理人办公场所

9.2 查阅方式

上述备查文件存放在本基金管理人办公场所。

9.3 查阅费用

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印件或复印件。

9.4 联系方式

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 2018年10月25日

东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

收益率变动的比较



本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》。

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》。

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,本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》。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2018年7月1日起至2018年9月30日,本基金A类净值增长率为-0.19%,业绩比较基准收益率为0.33%,高于业绩比较基准3.24%。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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 报告期内前十名证券的发行主体在本报告期内未发生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 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

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.6 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

Table with 2 columns: 报告期末基金管理人持有本基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金份额占基金总份额比例

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。

8.1 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

本报告期末本基金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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 备查文件目录

- (一)东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金合同
(二)东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金托管协议
(三)东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
(四)基金管理人公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他相关信息
(五)基金管理人办公场所

9.2 查阅方式

上述备查文件存放在本基金管理人办公场所。

9.3 查阅费用

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印件或复印件。

9.4 联系方式

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 2018年10月25日

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未发生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 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

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.6 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

Table with 2 columns: 报告期末基金管理人持有本基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金份额占基金总份额比例

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。

8.1 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

本报告期末本基金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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 备查文件目录

- (一)东方利群混合型发起式证券投资基金基金合同
(二)东方利群混合型发起式证券投资基金托管协议
(三)东方利群混合型发起式证券投资基金招募说明书
(四)基金管理人公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他相关信息
(五)基金管理人办公场所

9.2 查阅方式

上述备查文件存放在本基金管理人办公场所。

9.3 查阅费用

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印件或复印件。

9.4 联系方式

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 2018年10月25日

本报告期末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

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11.6 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

Table with 2 columns: 报告期末基金管理人持有本基金份额, 报告期末基金管理人持有本基金份额占基金总份额比例

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。

8.1 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

本报告期末本基金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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 备查文件目录

- (一)东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同
(二)东方精选混合型开放式证券投资基金托管协议
(三)东方精选混合型开放式证券投资基金招募说明书
(四)基金管理人公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他相关信息
(五)基金管理人办公场所

9.2 查阅方式

上述备查文件存放在本基金管理人办公场所。

9.3 查阅费用

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印件或复印件。

9.4 联系方式

投资者还可在本基金管理人网站(www.orient-fund.com)查阅。