东方人工智能主题混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

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。

基金托管人中国农业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	东方人工智能主题混合
基金主代码	005844
交易代码	005844
前端交易代码	005844
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年6月7日
报告期末基金份额总额	119,151,546.36份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,通过深入研究人工智能主题相关行业,挖掘具备成长潜力的上市公司,结合积极主动的资产配置,力争获得基金的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据各类资产的市场趋势和收益风险水平进行分析,对股票、债券和货币市场工具等类别的资产进行动态调整,采用多因素分析框架,综合考虑宏观经济因素、市场估值因素、政策因素、市场情绪因素等进行基金的大类资产配置。
业绩比较基准	中证人工智能主题指数收益率×80%+银行活期存款利率(税后)×20%
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(2019年1月1日-2019年3月31日)
1.本期已实现收益	14,174,754.01
2.本期利润	35,314,673.78
3.加权平均基金份额本期利润	0.2168
4.期末基金资产净值	121,563,863.71
5.期末基金份额净值	1.0202

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。

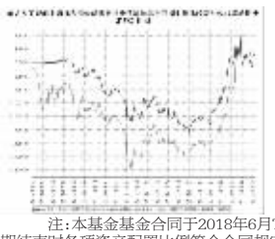
②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	23.29%	1.63%	35.91%	1.77%	-12.62%	-0.14%

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



注:本基金基金合同于2018年6月7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		
郭瑞(先生)	本基金基金经理	2018年6月7日	-	8年	中国科学院研究生院概率论与数理统计硕士,8年证券从业经历,曾任中国移动通信集团公司项目经理,宏源证券股份有限公司北京资产管理分公司高级研究员,润晖投资咨询(北京)有限公司高级研究员。2015年8月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任权益投资部研究员、东方创新科技混合型证券投资基金基金经理助理、东方策略成长混合型开放式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、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、现任东方创新科技混合型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、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理、东方人工智能主题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、《东方人工智能主题混合型证券投资基金金合同》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,上证指数上涨23.93%,深圳成指上涨36.84%,创业板指数上涨35.43%,沪深300指数上涨28.62%。个股和行业普遍出现明显上涨。

一季度,主要增持了启明星辰、中国国航、光大证券、中信证券、招商证券、中国平安等个股,减持了欧菲光、海格通信、杨杰科技等个股。

分析目前的宏观经济形势,我们认为二季度宏观经济增长存在放缓风险,市场在经历了一季度明显上涨之后,存在调整的可能性较大。我们将降低仓位,等待市场调整充分后的加仓机会。

从操作策略上,将保持"精选个股、长期持有",我们将继续精选个股,选择市场竞争格局好,行业发展较快,竞争力强,业绩增长较快,估值合理的个股进行投资。

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23.29%,业绩比较基准收益率为35.91%,低于业绩比较基准12.62%。

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	107,211,355.17	74.92
	其中:股票	107,211,355.17	74.92
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[注]	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产[注]	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	35,667,424.43	24.92
8	其他资产[注]	226,360.99	0.16
9	合计	143,105,140.59	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	1,698,812.28	1.40
B	采矿业	570,714.00	0.47
C	制造业	53,777,321.11	44.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,734,826.36	3.07
F	批发和零售业	1,713,156.48	1.41
G	交通运输、仓储和邮政业	3,495,611.96	2.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,124,053.59	9.15
J	金融业	22,189,761.00	18.25
K	房地产业	5,181,527.26	4.26
L	租赁和商务服务业	735,840.00	0.61
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	520,726.50	0.43
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	2,469,104.64	2.03
S	综合	-	-
	合计	107,211,355.17	88.19

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	002439	启明星辰	169,459	4,996,651.32	4.11
2	000333	美的集团	89,300	4,351,589.00	3.58
3	002049	紫光国微	84,300	3,796,029.00	3.12
4	600030	中信证券	152,500	3,778,950.00	3.11
5	600999	招商证券	210,700	3,691,464.00	3.04
6	601788	光大证券	280,300	3,688,748.00	3.03
7	000001	平安银行	283,800	3,638,316.00	2.99
8	601818	光大银行	896,400	3,634,240.00	2.99
9	601318	中国平安	47,000	3,623,700.00	2.98
10	002583	海能达	312,467	3,424,638.32	2.82

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	167,698.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,071.57
5	应收申购款	54,591.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	226,360.99

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

报告期期初基金份额总额	181,590,097.47
报告期期间基金总申购份额	8,741,846.16
减:报告期期间基金总赎回份额	71,180,397.27
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	119,151,546.36

§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、《东方人工智能主题混合型证券投资基金基金合同》

二、《东方人工智能主题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

东方添益债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

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。

基金托管人中国农业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	2,903,939,823.22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,力争基金资产长期、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,力争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(2019年1月1日-2019年3月31日)
1.本期已实现收益	27,873,271.25
2.本期利润	34,097,628.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.0132
4.期末基金资产净值	3,205,534,038.78
5.期末基金份额净值	1.1039

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。

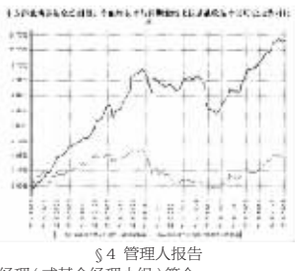
②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.72%	0.06%	0.47%	0.05%	1.25%	0.01%

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		
彭成军(先生)	本基金基金经理、公司总经理助理、固定收益投资总监、固定收益研究部总经理、投资决策委员会委员	2017年12月29日	-	12年	公司总经理助理、固定收益投资总监、固定收益研究部总经理、投资决策委员会委员。清华大学数学硕士,12年投资从业经历。曾任中国民生银行金融市场部投资管理中心总经理助理、交易中心负责人,负责固定收益及衍生品相关交易业务。2017年11月加盟东方基金管理有限责任公司,现任东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、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、东方睿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、东方睿远纯债债券型证券投资基金基金经理、东方睿锐回报债券型证券投资基金基金经理、东方睿选纯债债券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。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面,一季度经济的同步指标仍在下滑,但领先指标有所反弹,经济预期有所好转。从三大需求来看,出口增速在全球经济下行、抢出口消退的背景下明显走弱;投资端基建回暖、地产投资韧性仍在,带动总体投资增速有所企稳;消费增速由于汽车的拖累处于低位。通胀方面,呈现平稳回落的趋势,关注后期猪价走势。汇率方面,人民币在小幅升值后趋于稳定。领先指标方面,社融有所反弹,宽信用初见成效;PMI也有所好转,实体经济的信心有所改善。

债券市场方面,一季度10Y国债下行了16bp,10Y国开下行6bp,总体呈现下行随后区间震荡的走势。年初下行的主要原因是降准后资金面宽松行情;随后利率的反弹,主要是由于社融好于预期,股票市场明显反弹,风险偏好持续回暖,同时央行边际上收紧了过于宽松的资金面;在这一阶段,全球央行的超预期转鸽又对债券市场形成支撑。总体来看债券市场多空交错,走势震荡。

报告期内,本基金灵活调整久期及仓位,在信用风险可控情况下,优选中高等级信用债以获取稳健的底仓收益,充分发掘单个券种超额收益机会,利率债方面择机参与利率债波段机会,博取见塔收益,获得了较好的投资回报。

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1.72%,业绩比较基准收益率为0.47%,高于业绩比较基准1.25%。

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,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	4,143,366,091.60	96.72
	其中:债券	4,143,366,091.60	96.72
	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[注]	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产[注]	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,697,895.56	0.32
8	其他资产[注]	126,816,696.25	2.96
9	合计	4,283,880,683.41	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	1,181,224,267.90	36.85
	其中:政策性金融债	1,181,224,267.90	36.85
4	企业债券	1,239,696,223.70	38.67
5	企业短期融资券	35,258,000.00	1.10
6	中期票据	1,279,589,600.00	39.92
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	407,598,000.00	12.72
10	合计	4,143,366,091.60	129.26

注:其他为地方政府债。

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	180406	18农发06	5,400,000	572,130,000.00	17.85
2	180204	18国开04	2,100,000	219,975,000.00	6.86
3	190401	19农发01	1,500,000	149,115,000.00	4.65
4	101801404	18鄂联投MTN006	1,400,000	145,054,000.00	4.53
5	1905009	19河南债04	1,100,000	109,802,000.00	3.43

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 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	122,379.97
2	应收证券清算款	48,884,891.20
3	应收股利	-
4	应收利息	74,322,962.12
5	应收申购款	3,486,462.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	126,816,696.25

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	1,405,598,334.76
报告期期间基金总申购份额	2,246,456,429.22
减:报告期期间基金总赎回份额	748,114,940.76
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	2,903,939,823.22

§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	20190110 - 20190113		261,449,069.76	91,339,970.77	-	352,789,040.53	12.15%
个人	-	-		-	-	-	-	-

产品特有风险

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

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

东方新价值混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

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。

基金托管人中国农业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	东方新价值混合
基金主代码	001495
交易代码	001495
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月3日
报告期末基金份额总额	22,291,080.77份
投资目标	本基金在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,积极把握行业和个股投资机会,通过对投资价值突出的优质股票投资,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据资本市场实际情况对大类资产比例进行动态调整,力求有效地回避证券市场的系统性风险。同时,以专业的研究分析为根本,挖掘市场中有潜力的投资标的和被低估的投资品种,获得基金的长期稳定增值。
业绩比较基准	一年期定期存款利率(税后)*2
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	中国农业银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	东方新价值混合A / 东方新价值混合C
下属分级基金的交易代码	001495 / 002162
报告期末下属分级基金的份额总额	22,290,861.10份 / 219.67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)	
	东方新价值混合A	东方新价值混合C
1. 本期已实现收益	-2,258,360.77	-17.83
2. 本期利润	-551,457.99	-4.33
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0243	-0.0213
4. 期末基金资产净值	25,126,254.30	222.87
5. 期末基金份额净值	1.1272	1.0146

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

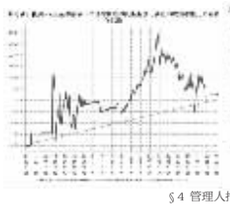
东方新价值混合A

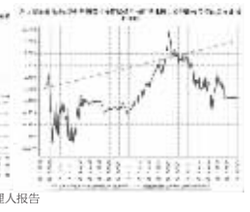
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.08%	0.33%	0.72%	0.01%	-2.80%	0.32%

东方新价值混合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	-2.08%	0.33%	0.74%	0.01%	-2.82%	0.32%

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		
薛子微(先生)	本基金基金经理	2015年7月3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、东方睿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。
周薇(女士)	本基金基金经理	2015年7月3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、东方永利18个月定期开放债券型证券投资基金(于2017年8月23日起转型为东方永利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、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方