东方新兴成长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	东方新兴成长混合
基金主代码	400025
交易代码	400025
前端交易代码	400025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月3日
报告期末基金份额总额	113,480,674.61份
投资目标	本基金以稳健收益为目标,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	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。同时,重点投资于符合本基金定义的新兴成长股票,获得基金的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%
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	4,253,123.61
2.本期利润	37,175,739.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.3160
4.期末基金资产净值	185,301,335.42
5.期末基金份额净值	1.6329

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。

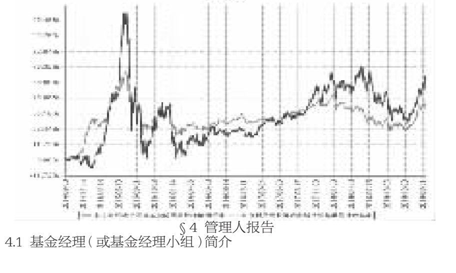
②所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	24.22%	1.24%	16.59%	0.92%	7.63%	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		
王然(女士)	本基金基金经理、权益研究部副总经理、投资决策委员会委员	2015年6月25日	-	11年	权益研究部副总经理,投资决策委员会委员,北京交通大学产业经济学硕士,11年证券从业经历,曾任益民基金交通运输、纺织服装、轻工制造行业研究员。2010年4月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究员,东方策略成长股票型开放式证券投资基金(于2015年8月7日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金)基金经理助理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金(于2015年8月7日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金)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日转型为东方成长收益平衡混合型基金)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、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理,现任东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新兴成长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、东方民丰回报赢安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、东方大健康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、《东方新兴成长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1季度,上证综指上涨28%、深圳成指上涨40%、创业板指上涨35%、沪深300上涨32%、上证50上涨24%。分行业看,1季度全行业普涨,涨幅前三的行业分别是非银金融、计算机、军工,涨幅分别为50%、46%、46%;涨幅后三的行业分别为银行、汽车、服装,涨幅分别为23%、23%、26%。从风格上看,科创类和消费类明显好于周期类。

2019年1季度,市场全面普涨,主要原因有以下几点:第一,2019年延续了2018年下半年以来的宽货币政策,特别是1月份信贷数据超预期推升了市场对资金面放水的预期,整体风险偏好得到提升。第二,减税政策如期出台,配合信用宽松政策,给亟待纾困的中小企业起到了雪中送炭的作用,上市公司盈利有望企稳回升,市场对于国内经济降速的悲观预期有所修复。第三,国家对金融服务业做出了更高的定位,将科创板上升到战略高度,科创板政策和拟申报公司的陆续披露,推升科创板与主板、创业板的比价效应预期,科创类龙头获得资金的追捧。第四,今年大比例纳入MSCI(含创业板标的)给市场带来了边际增量资金,同时随着市场企稳回升,两融规模迅速扩大,市场的赚钱效应开始显现。第五,在2018年一直困扰市场的中美贸易问题也在双方的努力下有望取得进展,2019年这一问题已经不构成影响市场的主要矛盾。

以上因素在1季度集中爆发,超出了市场和我们的原有预期,因此我们在2月份对仓位进行了提升,小幅增加了受益于货币放松和政策边际趋松的房地产行业及相关产业链,并仍将大部分仓位着重配置在具备长期成长性的优质消费品龙头上。

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24.22%,业绩比较基准收益率为16.59%,高于业绩比较基准7.63%。

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	164,193,265.16	86.37
	其中:股票	164,193,265.16	86.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,008,000.00	5.26
	其中:债券	10,008,000.00	5.26
	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	6,000,000.00	3.16
	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	8,733,447.17	4.59
8	其他资产	1,176,365.29	0.62
9	合计	190,111,077.62	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	2,436,000.00	1.31
B	采矿业	-	-
C	制造业	105,740,135.14	57.06
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	12,132,587.02	6.55
J	金融业	14,562,843.00	7.86
K	房地产业	14,641,800.00	7.90
L	租赁和商务服务业	5,606,400.00	3.03
M	科学研究和技术服务业	3,052,000.00	1.65
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	4,309,500.00	2.33
R	文化、体育和娱乐业	1,712,000.00	0.92
S	综合	-	-
	合计	164,193,265.16	88.61

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	002032	苏泊尔	119,948	8,999,698.44	4.86
2	600276	恒瑞医药	120,000	7,850,400.00	4.24
3	600519	贵州茅台	9,000	7,685,910.00	4.15
4	603288	海天味业	88,500	7,672,950.00	4.14
5	600340	华夏幸福	240,000	7,444,800.00	4.02
6	600887	伊利股份	235,000	6,840,850.00	3.69
7	000858	五粮液	63,500	6,032,500.00	3.26
8	300122	智飞生物	110,000	5,621,000.00	3.03
9	002035	华帝股份	400,031	5,612,434.93	3.03
10	601888	中国国旅	80,000	5,606,400.00	3.03

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	10,008,000.00	5.40
	其中:政策性金融债	10,008,000.00	5.40
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	10,008,000.00	5.40

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	180410	18农发10	100,000	10,008,000.00	5.40
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

本基金所持有的苏泊尔(002032)于2018年4月11日公告,公司存在违规行为,违规类型是“未及时披露定期报告”,内容是“因你公司网络和系统的原因,你公司未能在原预约的2018年3月30日披露2017年年度报告,你公司股票于2018年3月30日开市起停牌。3月31日,你公司披露了2017年年度报告等相关文件。4月2日,你公司股票复牌。”深圳证券交易所对公司的处分措施为“对浙江苏泊尔股份有限公司予以监管关注”。

公司接受的以上处罚不会对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。

本基金投资苏泊尔主要基于以下原因:公司是小家电龙头公司,拥有较强的产品力、品牌力和渠道力,且在过去10年拥有良好的财务指标和市场信誉,是具备长期投资价值的品牌家电公司。

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	117,739.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	103,643.64
5	应收申购款	954,982.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,176,365.29

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的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	119,710,711.96
报告期期间基金总申购份额	2,574,431.28
减:报告期期间基金总赎回份额	8,804,468.63
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	113,480,674.61

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	8,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	8,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	35.40

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、《东方新兴成长混合型证券投资基金基金合同》
二、《东方新兴成长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

东方永泰纯债1年定期开放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18日(基金合同生效日)起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方永泰纯债1年定期开放债券	
基金主代码	006715	
交易代码	006715	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年1月18日	
报告期末基金份额总额	689,664,921.10份	
投资目标	本基金在严格控制投资风险的前提下,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期、稳定增值。	
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	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	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东方永泰纯债1年定期开放债券A	东方永泰纯债1年定期开放债券C
下属分级基金的交易代码	006715	006716
报告期末下属分级基金的份额总额	647,582,057.59份	42,082,863.51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18日 - 2019年3月31日)	
	东方永泰纯债1年定期开放债券A	东方永泰纯债1年定期开放债券C
1.本期已实现收益	4,065,547.66	230,852.39
2.本期利润	2,921,346.36	156,502.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0045	0.0037
4.期末基金资产净值	650,503,403.95	42,239,366.15
5.期末基金份额净值	1.0045	1.0037

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

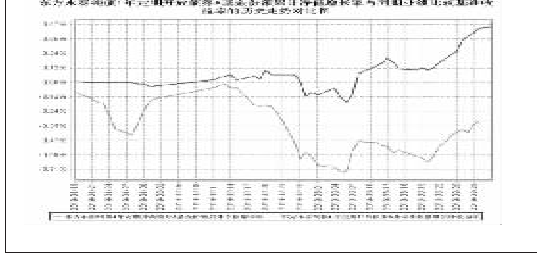
东方永泰纯债1年定期开放债券A

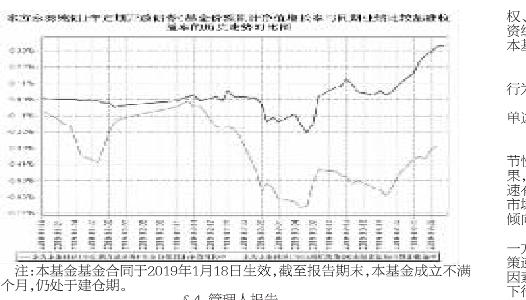
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.45%	0.05%	-0.32%	0.07%	0.77%	-0.02%

东方永泰纯债1年定期开放债券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	0.37%	0.05%	-0.32%	0.07%	0.69%	-0.02%

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2019年1月18日生效,截至报告期末,本基金成立不满六个月,仍处于建仓期。

§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	2019年1月18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、东方臻悦纯债债券型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理,现任东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方臻选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、东方永泰纯债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、《东方永泰纯债1年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,社融同比基本已筑底;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,中游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年以来随着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,年初至春节利率债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,本基金处于建仓期,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18日起至2019年3月31日,本基金A类净值增长率为0.45%,业绩比较基准收益率为-0.32%,高于业绩比较基准0.77%;本基金C类净值增长率为0.37%,业绩比较基准收益率为-0.32%,高于业绩比较基准0.69%。

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	697,477,292.40	91.80
	其中:债券	697,477,292.40	91.80
	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	48,050,164.67	6.32
8	其他资产	14,241,939.31	1.87
9	合计	759,769,396.38	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	39,840,000.00	5.75
	其中:政策性金融债	39,840,000.00	5.75
4	企业债券	596,267,292.40	86.07
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	61,370,000.00	8.86
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	697,477,292.40	100.68

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	143025	17辽能01	600,000	61,170,000.00	8.83
2	143075	17重汽01	500,000	51,585,000.00	7.45
3	143765	18津投07	500,000	50,615,000.00	7.31
4	136057	15华发01	400,000	41,032,000.00	5.92
5	136898	17蚌投01	400,000	40,484,000.00	5.84

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。

本基金所持有16港务02(136839),发行人厦门港务控股集团有限公司(以下简称“公司”),受到行政处罚。

于2018年9月14日,公司收到中国证券监督管理委员会厦门监管局《监管关注函》(厦证监【2018】306号),主要针对公司开展的公司债券现场检查中所发现的问题:(一)信息披露不完整;(二)公司治理不健全。

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,并报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1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。

本基金投资16港务02(136839)主要基于以下原因:

厦门港务控股集团有限公司成立于1997年11月4日,公司的前身是厦门市交通国有资产投资有限公司,系依据1997年7月25日厦门市人民政府“厦府(1997)综092号”《厦门市人民政府关于成立厦门市交通国有资产投资有限公司的批复》组建的国有独资公司。是福建省港口龙头企业,厦门市十大国有企业集团,海峡西岸最大、最具实力的港口及综合物流运营商,拥有厦门国际港务股份有限公司(证券代码:HK3378)、厦门港务发展股份有限公司(证券代码:SZ000905)两家境外、境内上市企业。近年,集团及集团下属单位陆续获得了“福建省企业文化建设示范单位”、“福建省思想政治工作优秀企业”、“中国最佳集装箱港口(码头)公司”、“全国五四红旗团委”、“全国群众体育先进单位”、“全国无偿献血先进单位”、“全国十佳交通文明窗口”、“特区建设二十五周年突出贡献企业”等荣誉称号。

16港务02(136839)的债项评级为AAA,主体评级为AAA,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	62,644.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,179,295.04
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,241,939.31

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	东方永泰纯债1年定期开放债券A	东方永泰纯债1年定期开放债券C
基金合同生效日(2019年1月18日)基金份额总额	647,582,057.59	42,082,863.51
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	647,582,057.59	42,082,863.51

注:本基金基金合同于2019年1月18日生效。

§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、《东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金合同》
二、《东方永泰纯债1年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

东方臻宝纯债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:中国光大银行股份有限公司
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。

基金托管人中国光大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	东方臻宝纯债债券	
基金主代码	006210	
交易代码	006210	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年8月8日	
报告期末基金份额总额	235,511.36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	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东方臻宝纯债债券A	东方臻宝纯债债券C
下属分级基金的交易代码	006210	006211
报告期末下属分级基金的份额总额	2,898.40份	232,612.96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)	
	东方臻宝纯债债券A	东方臻宝纯债债券C
1.本期已实现收益	24,620,477.80	86,625.56
2.本期利润	17,741,455.34	13,267.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0132	0.0487
4.期末基金资产净值	10,314.17	243,248.41
5.期末基金份额净值	3.5586	1.0457

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

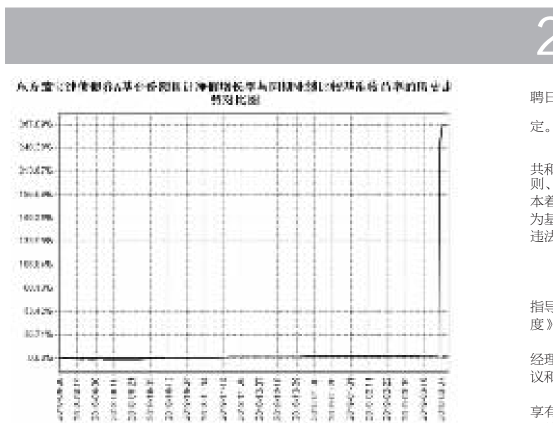
东方臻宝纯债债券A

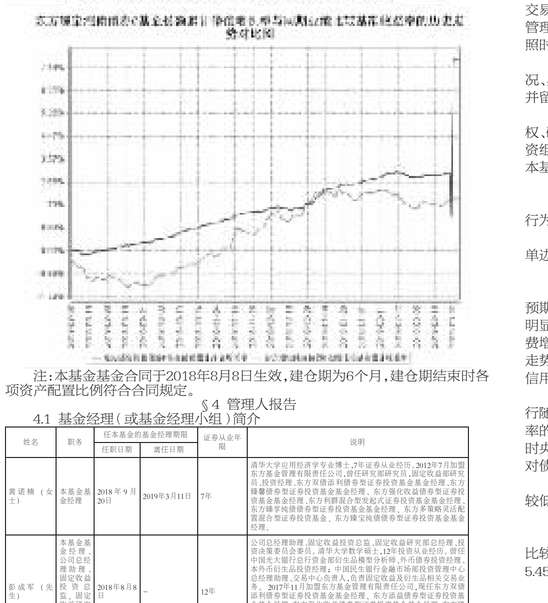
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	259.39%	30.57%	0.15%	0.09%	259.24%	30.48%

东方臻宝纯债债券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	5.45%	0.81%	0.15%	0.09%	5.30%	0.72%

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8月8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		
黄诺楠(女士)	本基金基金经理	2018年9月20日	2019年3月11日	7年	清华大学应用经济学专业博士,7年证券从业经历。2012年7月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任研究部研究员,固定收益部研究员,投资经理、东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方臻馨债券型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、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理、东方臻享纯债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、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理。
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	2018年8月8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。曾任中国光大银行总行资金部衍生品模型分析师、外币债券投资经理、本外币衍生品投资经理;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、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻享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、东方臻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、《东方臻宝纯债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,本基金面临大额赎回,持仓主要为高评级信用债,组合久期控制在较低位置,保持了组合较好的流动性,从而实现风险与收益的平衡。

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259.39%,业绩比较基准收益率为0.15%,高于业绩比较基准259.24%;本基金C类净值增长率为5.45%,业绩比较基准收益率为0.15%,高于业绩比较基准5.30%。

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	204,680.00	19.92
	其中:债券	204,680.00	19.92
	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	594,737.36	57.87
8	其他资产	228,217.87	22.21
9	合计	1,027,635.23	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	204,680.00	80.72
	其中:政策性金融债	204,680.00	80.72
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	204,680.00	80.72

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	018006	国开1702	2,000	204,680.00	80.72
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	26,948.74
2	应收证券清算款	153,067.46
3	应收股利	-
4	应收利息	44,287.46
5	应收申购款	3,914.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	228,217.87

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	东方臻宝纯债债券A	东方臻宝纯债债券C
报告期期初基金份额总额	1,502,323,309.64	291,960.23
报告期期间基金总申购份额	4,177.06	14,071.94
减:报告期期间基金总赎回份额	1,502,324,588.30	73,419.21
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	2,898.40	232,612.96

§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 - 20190325	1,502,252,378.56	-	1,502,252,378.56	-	-
个人	1	20190326 - 20190331	180,027.00	-	-	180,027.00	76.44%
	2	20190326 - 20190331	39,766.21	9,699.32	-	49,465.53	21.00%
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、《东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金合同》
二、《东方臻宝纯债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