

东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

报告期内,本基金坚持绝对收益的投资策略,持仓股以金融、消费等板块蓝筹股为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现
2019年4月1日起至2019年6月30日,本基金净值增长率为-0.46%,业绩比较基准收益率为-0.76%,高于业绩比较基准0.30%。

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,受基金份额持有人赎回等因素影响,本基金存在基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况。截至报告期末,本基金基金资产净值已达到五千万元以上。

§ 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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	42,020,197.18	24.76
2	债券投资	92,920,971.17	53.75
3	基金投资	-	-
4	固定收益类资产	102,540,000.00	58.77
5	其他资产	102,540,000.00	58.77
6	资产支持证券	-	-
7	衍生品投资	-	-
8	其他金融工具	-	-
9	其他	-	-
10	合计	235,481,168.35	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,230,281.20	1.38
B	采矿业	-	-
C	制造业	28,394,324.18	12.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,080,000.00	1.76
E	建筑业	4,080,000.00	1.76
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	1,077,000.00	0.47
I	金融业	79,670,716.70	34.69
J	房地产业	25,380,000.00	11.00
K	租赁和商务服务业	1,040,700.00	0.46
L	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	卫生和社会工作	-	-
O	教育、文化和体育业	-	-
P	娱乐、休闲和旅游业	-	-
Q	其他行业	-	-
合计	权益投资合计	82,830,917.97	36.76

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	600921	海信家电	1,280,723.00	49,402.80	2.15
2	600024	中国船舶	52,000.00	4,380,000.00	1.90
3	601969	长源电力	1,000,000.00	5,000,000.00	2.19
4	600275	航天信息	85,000.00	5,320,000.00	2.32
5	601208	华信新材	5,200,000.00	5,320,000.00	2.32
6	600030	中信证券	280,000.00	5,320,000.00	2.32
7	600000	浦发银行	280,000.00	5,320,000.00	2.32
8	600000	浦发银行	280,000.00	5,320,000.00	2.32
9	600000	浦发银行	280,000.00	5,320,000.00	2.32
10	600000	浦发银行	280,000.00	5,320,000.00	2.32

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000000	国债	1,280,723.00	49,402.80	2.15
2	000000	国债	52,000.00	4,380,000.00	1.90
3	000000	国债	1,000,000.00	5,000,000.00	2.19
4	000000	国债	85,000.00	5,320,000.00	2.32
5	000000	国债	5,200,000.00	5,320,000.00	2.32
6	000000	国债	280,000.00	5,320,000.00	2.32
7	000000	国债	280,000.00	5,320,000.00	2.32
8	000000	国债	280,000.00	5,320,000.00	2.32
9	000000	国债	280,000.00	5,320,000.00	2.32
10	000000	国债	280,000.00	5,320,000.00	2.32

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十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000000	国债	1,280,723.00	49,402.80	2.15
2	000000	国债	52,000.00	4,380,000.00	1.90
3	000000	国债	1,000,000.00	5,000,000.00	2.19
4	000000	国债	85,000.00	5,320,000.00	2.32
5	000000	国债	5,200,000.00	5,320,000.00	2.32
6	000000	国债	280,000.00	5,320,000.00	2.32
7	000000	国债	280,000.00	5,320,000.00	2.32
8	000000	国债	280,000.00	5,320,000.00	2.32
9	000000	国债	280,000.00	5,320,000.00	2.32
10	000000	国债	280,000.00	5,320,000.00	2.32

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五名资产支持证券投资明细

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

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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.12 报告期末本基金持有的股票期权投资情况

5.13 报告期末本基金持有的国债期货投资情况

5.14 报告期末本基金持有的大宗商品投资情况

5.15 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.16 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.17 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.18 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.19 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.20 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.21 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.22 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.23 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.24 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.25 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.26 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.27 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.28 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.29 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.30 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.31 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.32 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.33 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.34 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.35 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.36 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.37 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.38 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.39 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.40 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.41 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.42 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.43 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.44 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.45 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.46 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.47 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.48 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.49 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.50 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.51 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.52 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.53 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.54 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.55 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.56 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.57 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.58 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.59 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.60 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.61 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.62 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.63 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.64 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.65 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.66 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.67 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.68 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.69 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.70 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.71 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.72 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.73 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.74 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.75 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.76 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.77 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.78 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.79 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.80 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.81 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.82 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.83 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.84 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.85 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.86 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.87 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.88 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.89 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.90 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.91 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.92 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.93 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.94 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.95 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.96 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.97 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.98 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.99 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.100 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.101 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.102 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.103 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.104 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.105 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.106 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.107 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.108 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.109 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.110 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.111 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.112 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.113 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.114 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.115 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.116 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.117 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.118 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.119 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.120 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.121 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.122 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.123 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.124 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.125 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.126 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.127 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.128 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.129 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.130 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.131 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.132 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.133 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.134 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.135 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.136 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.137 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.138 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.139 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.140 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.141 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.142 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.143 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.144 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.145 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.146 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.147 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.148 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.149 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.150 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.151 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.152 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.153 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.154 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.155 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.156 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.157 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.158 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.159 报告期末本基金持有的其他衍生品投资情况

5.