

东方人工智能主题混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

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、反向交易价差、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,未直接或通过第三方交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

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所公开竞价同日反向交易成交较多的单边交易超过该证券当日成交5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作情况
2019年二季度,上证指数下跌了3.62%,深圳成指下跌了7.26%,创业板指下跌了10.75%,沪深300下跌了1.21%。个股和行业进一步分化,食品饮料、家电、非银等行业明显上涨,传媒、轻工、钢铁等行业明显下跌。

二季度,主要增持了海康威视、中航光电、中兴通讯、国电南瑞等个股,减持了启明星辰、紫光国微、中信证券、招商证券、光大证券等个股。

市场经历了一季度的明显上涨,二季度的震荡调整,进入三季度,市场将更为关注上市公司中报情况。目前市场预期三季度宏观经济有望见底回升,流动性阶段性持续宽松,目前中美贸易科技摩擦目标且谈,市场情绪波动明显。随着科创板开板,我们认为科技将成为阶段性的市场主题。我们认为市场在三季度将呈现震荡上行的趋势。

从操作策略上,我们将保持对权益的谨慎,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4月1日起至2019年6月30日,本基金净值增长率为-9.19%,业绩比较基准收益率为-7.27%,低于业绩比较基准1.92%。

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

Table with 5 columns: 序号, 投资组合, 持仓比例(%) 基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末持有股票投资

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 6 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
本基金本报告期末持有债券投资

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 6 columns: 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(%)

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

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 其他地方政府债

5.13 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股指期货投资

5.14 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

5.15 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

5.16 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

5.17 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

5.18 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

5.19 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.20 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.21 投资组合报告附注

5.22 其他地方政府债

5.23 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股指期货

5.24 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

5.25 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

5.26 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

5.27 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

5.28 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

5.29 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.30 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.31 投资组合报告附注

5.32 其他地方政府债

5.33 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股指期货

5.34 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

5.35 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

5.36 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

5.37 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

5.38 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

5.39 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.40 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.41 投资组合报告附注

5.42 其他地方政府债

5.43 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股指期货

5.44 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

5.45 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

5.46 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

5.47 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

5.48 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

5.49 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.50 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.51 投资组合报告附注

5.52 其他地方政府债

5.53 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股指期货

5.54 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

5.55 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

5.56 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

5.57 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

5.58 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

5.59 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.60 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.61 投资组合报告附注

5.62 其他地方政府债

5.63 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股指期货

5.64 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

5.65 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

5.66 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

5.67 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

5.68 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

5.69 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.70 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.71 投资组合报告附注

5.72 其他地方政府债

5.73 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股指期货

5.74 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

5.75 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

5.76 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

5.77 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

5.78 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

5.79 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.80 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.81 投资组合报告附注

5.82 其他地方政府债

5.83 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股指期货

5.84 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

5.85 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

5.86 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

5.87 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

5.88 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

5.89 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.90 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.91 投资组合报告附注

5.92 其他地方政府债

5.93 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股指期货

5.94 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

5.95 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

5.96 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

5.97 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

5.98 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

5.99 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.100 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.101 投资组合报告附注

5.102 其他地方政府债

5.103 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股指期货

5.104 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

5.105 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

5.106 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

5.107 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

5.108 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

5.109 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.110 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.111 投资组合报告附注

5.112 其他地方政府债

5.113 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股指期货

5.114 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

5.115 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

5.116 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

5.117 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

5.118 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

5.119 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.120 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.121 投资组合报告附注

5.122 其他地方政府债

5.123 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股指期货

5.124 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

5.125 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

5.126 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

5.127 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

5.128 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

5.129 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.130 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.131 投资组合报告附注

5.132 其他地方政府债

5.133 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股指期货

5.134 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

5.135 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

5.136 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

5.137 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

5.138 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

5.139 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.140 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.141 投资组合报告附注

5.142 其他地方政府债

5.143 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股指期货

5.144 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

5.145 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

5.146 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

5.147 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

5.148 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

5.149 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.150 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.151 投资组合报告附注

5.152 其他地方政府债

5.153 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股指期货

5.154 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

5.155 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

5.156 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

5.157 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

5.158 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

5.159 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.160 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.161 投资组合报告附注

5.162 其他地方政府债

5.163 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股指期货

5.164 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

5.165 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

5.166 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

5.167 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

5.168 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

5.169 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.170 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.171 投资组合报告附注

5.172 其他地方政府债

5.173 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股指期货

5.174 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

5.175 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

5.176 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

5.177 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

5.178 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

5.179 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.180 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.181 投资组合报告附注

5.182 其他地方政府债

5.183 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股指期货

5.184 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

5.185 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

5.186 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

5.187 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

5.188 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

5.189 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.190 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.191 投资组合报告附注

5.192 其他地方政府债

5.193 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股指期货

5.194 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

5.195 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

5.196 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

5.197 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

5.198 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

5.199 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.200 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.201 投资组合报告附注

5.202 其他地方政府债

5.203 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股指期货

5.204 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

5.205 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

5.206 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

5.207 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

5.208 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

5.209 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.210 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.211 投资组合报告附注

5.212 其他地方政府债