

东海祥瑞债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

高效的管理原则和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

公司公平交易制度适用于所有投资品种,以及所有投资管理活动,涵盖授权、研究分析、投资决策与交易执行、业绩评估与投资监督活动各环节,从研究、投资、交易、评价、监督等多方面,严格执行公平交易制度,并由风险监察部负责公平交易情况定期报告和不定期评估。

根据《中国证监会关于证券投资基金公平交易行为的指导意见》,公司制定了公平交易制度和公平交易监控机制,并定期对组合间同向交易行为、公司禁入组合内的同向反向交易、严格控制组合间的同向反向交易,对采用量化投资策略的组合以及完全按照有关指数构成比例进行投资的组合与该组合相关的同日反向交易行为进行定期分析。本报告期期内基金管理人管理的所有投资组合与交易所公开的同日反向交易行为较少的单边交易量占该证券总成交量的交易次数为0次。

本报告期期内,各组合间交易情况出现异常情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年第二季度,国内经济复苏动能快速上升后行情震荡下行。宏观政策方面,财政政策继续发力,货币政策适当保持稳健,国内金融环境未出现明显收紧的倾向。

公司公平交易制度和公平交易监控机制,同时加强对组合间同向交易和日反向交易的监控和检查。公司利用公平交易分析系统,对组合在不同时间窗口的同向交易情况进行持续监控,并定期对组合间的同向反向交易分析。公司禁入组合内的同向反向交易,严格控制组合间的同向反向交易,对采用量化投资策略的组合以及完全按照有关指数构成比例进行投资的组合与该组合相关的同日反向交易行为进行定期分析。本报告期期内基金管理人管理的所有投资组合与交易所公开的同日反向交易行为较少的单边交易量占该证券总成交量的交易次数为0次。

本报告期期内,各组合间交易情况出现异常情况。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,东海祥瑞A级基金份额净值为1.0505元,本报告期基金份额净值增长率为0.09%;截至本报告期末东海祥瑞C级基金份额净值为1.0393元,本报告期基金份额净值增长率为0.09%;同期业绩比较基准收益率为-0.18%。

4.6 报告期内基金的利润分配情况

本报告期期内,本基金未有连滚带利。本报告期基金份额持有人数量不足200人,基金管理人员在履行信息披露义务时,可将其纳入大宗交易范围。基金的投向组合比例为:本基金对基金的股权投资比例不低于基金资产的90%,持有的现金或到期日在一年以内(含一年)的银行存款和投资于货币市场基金的比例不超过基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

4.7 报告期内基金的费用情况

本报告期期内,基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的有关规定,诚实守信、勤勉尽责、安全

高效的管理原则和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

5.2.2 报告期末未按行业分类的股票投资品种投资组合

注:本基金本报告期末持有股票投资组合。

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

注:本基金本报告期末持有股票投资组合。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末持有债券投资组合。

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

注:本基金本报告期末持有债券投资组合。

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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末持有贵金属投资组合。

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:基金管理人持有本基金份额变动情况。

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本基金本报告期末持有本基金份额变动情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

7.3 投资组合报告

注:本基金本报告期末持有投资组合情况。

7.4 开放式基金份额变动

注:本基金本报告期末持有处于转入期的可转换债券明细。

7.5 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股票。

7.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	900500
2	吸收存款及应计利息	
3	应收利息	
4	应付交易费用	6,536,389.02
5	应付管理人报酬	17,091.20
6	应付托管费	
7	应付券商佣金	
8	其他	
9	合计	6,556,793.07

5.10 报告期末持有的处于转入期的可转换债券明细。

本基金本报告期末持有处于转入期的可转换债券。

本基金本报告期末前十名股票中存在流通受限情况。

5.11 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

6.1 开放式基金份额变动

注:本基金本报告期末持有处于转入期的可转换债券明细。

6.2 报告期末未按行业分类的股票投资品种投资组合

注:本基金本报告期末持有股票投资组合。

6.3 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

注:本基金本报告期末持有股票投资组合。

6.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末持有债券投资组合。

6.5 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

注:本基金本报告期末持有债券投资组合。

6.6 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贵金属投资明细

注:本基金本报告期末持有贵金属投资组合。

6.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:基金管理人持有本基金份额变动情况。

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本基金本报告期末持有本基金份额变动情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期末基金管理人运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

7.3 投资组合报告

注:本基金本报告期末持有投资组合情况。

7.4 开放式基金份额变动

注:本基金本报告期末持有处于转入期的可转换债券明细。

7.5 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股票。

7.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注:基金管理人持有本基金份额变动情况。

7.8 投资组合报告的其他信息

82.1 投资组合报告的其他信息

本基金报告期末不存在影响投资者决策的其他重要信息。

7.9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予基金募集注册的文件

2. 《东海祥瑞债券型证券投资基金基金合同》

3. 《东海祥瑞债券型证券投资基金招募说明书》

4. 《东海祥瑞债券型证券投资基金托管协议》

5. 基金管理人业务资格批件、营业执照

6. 基金托管人业务资格批件、营业执照

7. 投资组合报告的其他信息

9.2 份额持有人名册

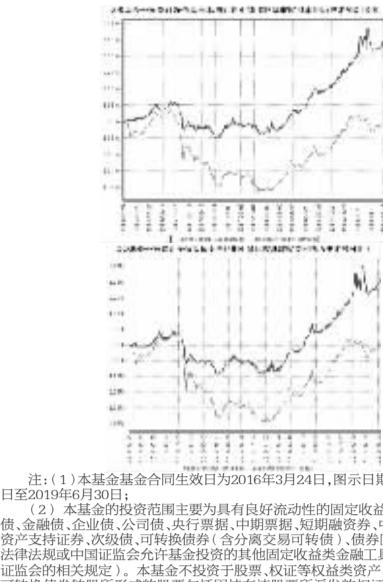
9.3 估值方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,在合理时间内取得上

述文件的复印件。

东海基金管理有限责任公司

2019年7月18日



注:(1)本基金合同生效日为2016年3月24日,份额日期为2016年3月24日

至2019年6月30日,基金资产净值=基金资产总值/基金份额总值。

注:(2)本基金投资运作主要具有良好的流动性特征的证券投资基金,包括基金、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券型基金、存款类金融工具(包括符合证监会规定的证券投资基金)、货币市场基金等。

注:(3)本基金合同生效日的基金资产净值=基金资产总值/基金份额总值。

注:(4)本基金投资运作主要具有良好的流动性特征的证券投资基金,包括基金、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券型基金、存款类金融工具(包括符合证监会规定的证券投资基金)、货币市场基金等。

注:(5)本基金投资运作主要具有良好的流动性特征的证券投资基金,包括基金、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券型基金、存款类金融工具(包括符合证监会规定的证券投资基金)、货币市场基金等。

注:(6)本基金投资运作主要具有良好的流动性特征的证券投资基金,包括基金、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券型基金、存款类金融工具(包括符合证监会规定的证券投资基金)、货币市场基金等。

注:(7)本基金投资运作主要具有良好的流动性特征的证券投资基金,包括基金、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券型基金、存款类金融工具(包括符合证监会规定的证券投资基金)、货币市场基金等。

注:(8)本基金投资运作主要具有良好的流动性特征的证券投资基金,包括基金、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券型基金、存款类金融工具(包括符合证监会规定的证券投资基金)、货币市场基金等。

注:(9)本基金投资运作主要具有良好的流动性特征的证券投资基金,包括基金、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券型基金、存款类金融工具(包括符合证监会规定的证券投资基金)、货币市场基金等。

注:(10)本基金投资运作主要具有良好的流动性特征的证券投资基金,包括基金、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券型基金、存款类金融工具(包括符合证监会规定的证券投资基金)、货币市场基金等。

注:(11)本基金投资运作主要具有良好的流动性特征的证券投资基金,包括基金、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券型基金、存款类金融工具(包括符合证监会规定的证券投资基金)、货币市场基金等。

注:(12)本基金投资运作主要具有良好的流动性特征的证券投资基金,包括基金、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券型基金、存款类金融工具(包括符合证监会规定的证券投资基金)、货币市场基金等。

注:(13)本基金投资运作主要具有良好的流动性特征的证券投资基金,包括基金、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券型基金、存款类金融工具(包括符合证监会规定的证券投资基金)、货币市场基金等。

注:(14)本基金投资运作主要具有良好的流动性特征的证券投资基金,包括基金、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券型基金、存款类金融工具(包括符合证监会规定的证券投资基金)、货币市场基金等。

注:(15)本基金投资运作主要具有良好的流动性特征的证券投资基金,包括基金、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券型基金、存款类金融工具(包括符合证监会规定的证券投资基金)、货币市场基金等。

注:(16)本基金投资运作主要具有良好的流动性特征的证券投资基金,包括基金、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券型基金、存款类金融工具(包括符合证监会规定的证券投资基金)、货币市场基金等。

注:(17)本基金投资运作主要具有良好的流动性特征的证券投资基金,包括基金、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券型基金、存款类金融工具(包括符合证监会规定的证券投资基金)、货币市场基金等。

注:(18)本基金投资运作主要具有良好的流动性特征的证券投资基金,包括基金、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券型基金、存款类金融工具(包括符合证监会规定的证券投资基金)、货币市场基金等。

注:(19)本基金投资运作主要具有良好的流动性特征的证券投资基金,包括基金、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券型基金、存款类金融工具(包括符合证监会规定的证券投资基金)、货币市场基金等。

注:(20)本基金投资运作主要具有良好的流动性特征的证券投资基金,包括基金、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、债券型基金、存款类金融工具(包括符合证监会规定的证券投资基金)、货币市场基金等。