

东方盛世灵活配置混合型证券投资基金2017年第1季度报告

2017年3月31日

基金管理人:东方基金管理有限责任公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十一日

\$1 重要提示
基金管理人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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月19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。
本报告自2017年1月1日起至3月31日止。

\$2 基金产品概况
基金简称:东方盛世灵活配置混合
基金代码:002497
交易代码:002497
前缀交易代码:002497
基金运作方式:契约开放式
基金合同生效日:2016年4月15日
报告期末基金份额总额:599,763,101.19份
投资目标:严格控制投资风险,采取灵活的资产配置策略,力争为投资者提供长期稳健的回报。

\$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
1.本期已实现收益 376,926.86
2.本期利润 8,481,073.29
3.加权平均基金份额本期利润 0.0111
4.期末基金份额净值 619.56154552
5.期末基金份额净值 1.030

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将低于所列数字。

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

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2016年4月15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约定。
\$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
王然(女士) 本基金基金经理 2016年4月15日 - 8年

王然(女士) 本基金基金经理 2016年4月15日 - 9年

周薇(女士) 本基金基金经理 2016年3月29日 - 8年

李(先生) 本基金基金经理 2016年3月29日 2017年3月24日 17年

注:①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定聘任和解聘日期。

②基金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。

\$6 开放式基金份额变动
单位:份
报告期初基金份额总额 773,367,777.17
报告期间基金份额净增加额 28,786.92
报告期末基金份额总额 773,631,469.90

\$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
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

\$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

投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
持有份额 份额占比
1 500,099,000.00 - 500,099,000.00 83.37

\$9 备查文件目录
9.1 备查文件目录
(一)《东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
(二)《东方盛世灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

东方基金管理有限责任公司 2017年4月21日

东方莱家保本混合型证券投资基金2017年第1季度报告

2017年3月31日

基金管理人:东方基金管理有限责任公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十一日

\$1 重要提示
基金管理人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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月19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。
本报告自2017年1月1日起至3月31日止。

\$2 基金产品概况
基金简称:东方莱家保本混合
基金代码:002480
交易代码:002480
前缀交易代码:002480
基金运作方式:契约开放式
基金合同生效日:2016年3月29日
报告期末基金份额总额:419,947,991.98份
投资目标:运用保本策略,通过动态调整股票与债券等资产,在有效控制投资风险、确保保本周期内本金安全的前提下,力求实现基金资产的长期稳定增值。

\$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
1.本期已实现收益 1,029,095.05
2.本期利润 5,429,446.31
3.加权平均基金份额本期利润 0.0129
4.期末基金份额净值 431.98602691
5.期末基金份额净值 1.0287

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将低于所列数字。

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金基金份额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2016年3月29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约定。
\$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
王然(女士) 本基金基金经理 2016年3月29日 - 9年

周薇(女士) 本基金基金经理 2016年3月29日 - 8年

李(先生) 本基金基金经理 2016年3月29日 2017年3月24日 17年

注:①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定聘任和解聘日期。

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。

\$6 开放式基金份额变动
单位:份
报告期初基金份额总额 419,947,991.98
报告期间基金份额净增加额 28,786.92
报告期末基金份额总额 419,947,991.98

\$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
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

\$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

投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
持有份额 份额占比
1 500,099,000.00 - 500,099,000.00 83.37

\$9 备查文件目录
9.1 备查文件目录
(一)《东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
(二)《东方盛世灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

东方基金管理有限责任公司 2017年4月21日

可能;贸易数据表现强势,结合各大港口经营数据,外贸回暖趋势不变。

从政策来看,2017年3月,全国以北京为代表的超过30个城市先后出台地产限购政策,弱化地产投资属性,防范资产泡沫。货币政策方面,央行态度边际收紧,并先后上调OMO、MLF等政策利率,提高负债成本,后续通胀和信贷仍是政策调控的证监重点目标。

从债券市场来看,2017年一季度资金面处于紧平衡状态,债券收益率震荡上行,十年国债利率年初上行30BP,主要受央行上调政策利率、基本面表现较好等因素影响。

从权益市场来看,市场整体呈现了趋势向上的态势,上证指数上涨3.83%,深成指上涨2.47%,创业板指下跌2.79%,分化明显。

我们在2016年末的判断是三四线城市库存带来的相关产业链如家电、家具等行业也将有所延续;供给侧改革和国企改革在2017年也将进入实质性阶段,在上游如钢铁、煤炭等领域也会有所表现,中国联调等国改标杆会对市场提振改革的信心;一带一路主题也将在5月份峰会之前有持续的表现,从2017年1季度的市场表现看,wind数据显示亮眼的行业有家电+13%、食品+11%、建筑材料+8%、建筑装饰+8%、交通运输+7%,基本符合我们前期的判断,而且我们认为在上半年这一趋势还将延续,但后续博弈情绪更加沉重,边际效应有所递减。

本基金股票资产仍以低估值、高分红、业绩稳健的消费品行业为主要配置方向,报告期内权益仓位不变,满足单边打新要求,由于受到保本新规影响,3月份之后对收益率产生一定影响。债券方面,以短久期城投、短债和存单为底仓,配合利率债的波段操作,适时根据市场变化进行了仓位和久期调整,主要集中在信用风险较小的老城投品种,组合回拨较小,同时保持组合较高的流动性,警惕信用违约风险。

\$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 60,213,994.11 11.60
其中:股票 60,213,994.11 11.60

\$2 基金资产净值变动
2.1 主要财务指标
单位:人民币元

主要财务指标
1.本期已实现收益 1,029,095.05
2.本期利润 5,429,446.31
3.加权平均基金份额本期利润 0.0129
4.期末基金份额净值 431.98602691
5.期末基金份额净值 1.0287

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将低于所列数字。

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金基金份额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2016年3月29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约定。
\$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
王然(女士) 本基金基金经理 2016年3月29日 - 9年

周薇(女士) 本基金基金经理 2016年3月29日 - 8年

李(先生) 本基金基金经理 2016年3月29日 2017年3月24日 17年

注:①此处的任职日期和离任日期分别指根据公司决定聘任和解聘日期。

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。

\$6 开放式基金份额变动
单位:份
报告期初基金份额总额 419,947,991.98
报告期间基金份额净增加额 28,786.92
报告期末基金份额总额 419,947,991.98

\$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
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

\$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

投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
持有份额 份额占比
1 500,099,000.00 - 500,099,000.00 83.37

\$9 备查文件目录
9.1 备查文件目录
(一)《东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
(二)《东方盛世灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

东方基金管理有限责任公司 2017年4月21日