

---

# 东方臻享纯债债券型证券投资基金

## 2018 年第 4 季度报告

2018 年 12 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年一月十八日

## § 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 1 月 16 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 2018 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	东方臻享纯债债券	
基金主代码	003837	
交易代码	003837	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 28 日	
报告期末基金份额总额	1,304,524,472.33 份	
投资目标	在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，实现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	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东方臻享纯债债券 A	东方臻享纯债债券 C
下属分级基金的交易代码	003837	003838
报告期末下属分级基金的份额总额	1,293,581,605.29 份	10,942,867.04 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（2018 年 10 月 1 日 — 2018 年 12 月 31 日）	
	东方臻享纯债债券 A	东方臻享纯债债券 C
1. 本期已实现收益	12,695,939.97	2,782,812.19
2. 本期利润	15,364,285.85	2,992,334.53
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0119	0.0115
4. 期末基金资产净值	1,435,890,952.74	12,396,681.08
5. 期末基金份额净值	1.1100	1.1329

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

东方臻享纯债债券 A

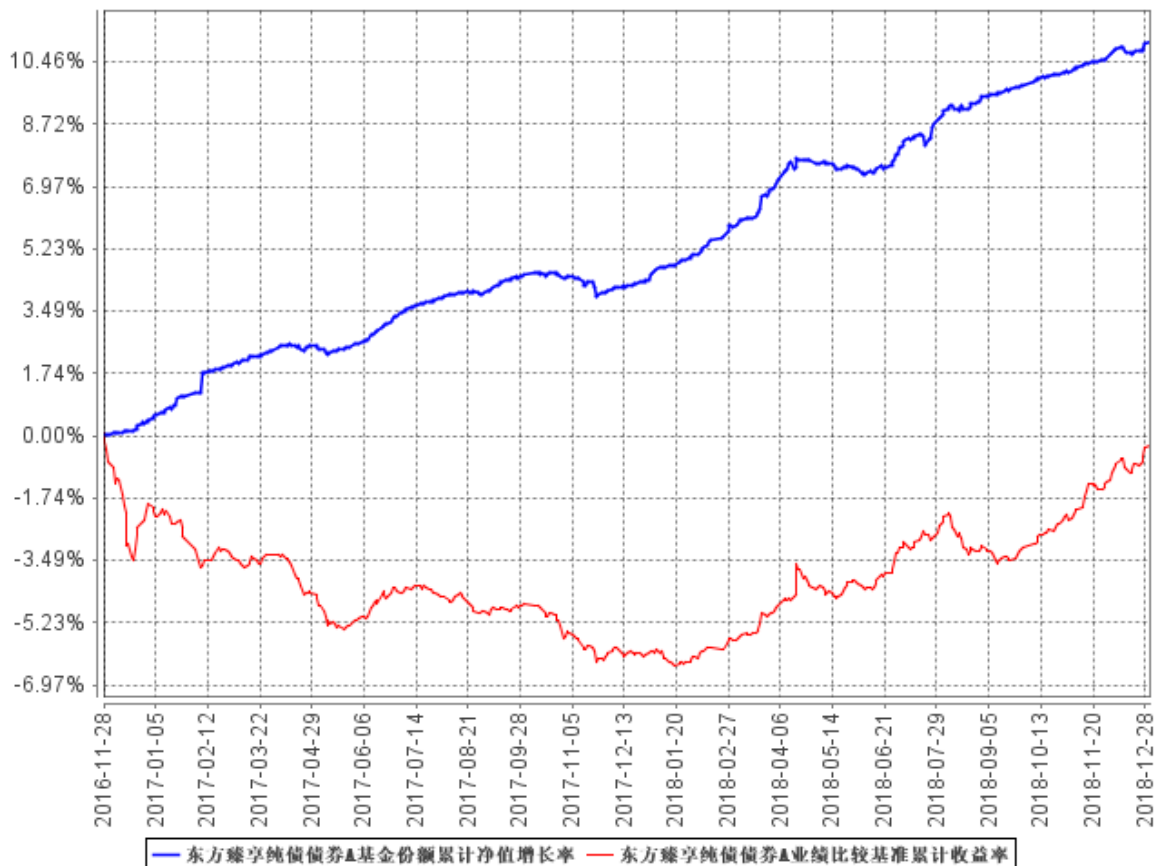
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.08%	0.03%	2.91%	0.09%	-1.83%	-0.06%

东方臻享纯债债券 C

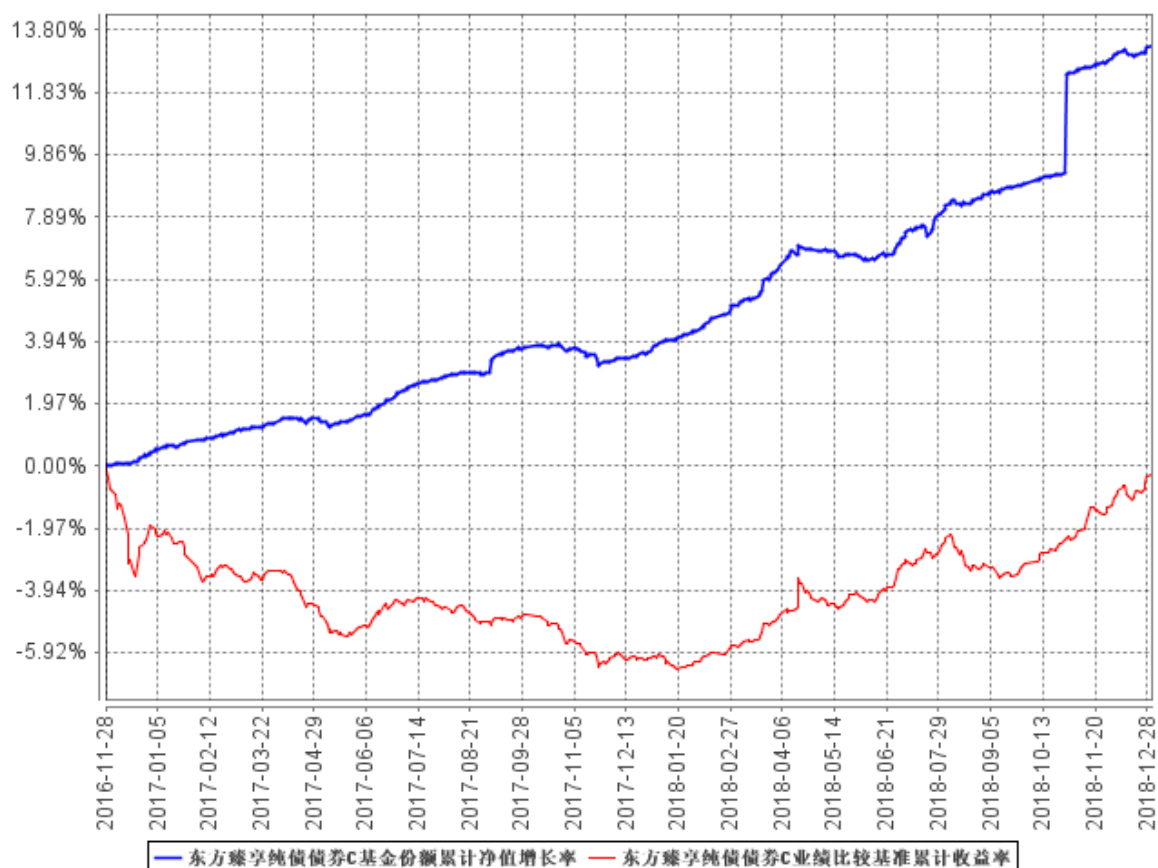
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.99%	0.37%	2.91%	0.09%	1.08%	0.28%

### 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

东方臻享纯债债券A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方臻享纯债债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 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	2016年12月12日	-	6年	清华大学应用经济学专业博士，6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，现任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 10 月 30 日	-	11 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，11 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。

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合规守信情况的说明

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、《东方臻享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内的公平交易程序；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

4 季度债券市场整体呈现牛市行情，几乎所有等级所有期限债券收益率均下行：10 年期国开收益率从 10 月 8 日的 4.18%下行至 3.64%，下行幅度为 54bp，信用债方面，以 5 年期企业债 AA+ 为例，从 4.85%下行至 4.43%，下行 42bp，2 年期从 4.31%下行至 4%，下行 31bp，在这一下行过程中，整体振幅不大。10 月跨节后，市场资金泛滥，流动性充裕，做多情绪高涨，隔夜利率一度跌至 1.5%低位，虽然月末央行开展了定向正回购，但这一状况并未实质性地改变资金面，11 月继

续延续 10 月走势，及至 12 月，央行创设定向中期借贷便利（TMLF），加大对小微企业、民营企业的金融支持力度。市场利率在 12 月中下旬有所冲高，但随后回落，收益率上行乏力。4 季度整体的经济和金融数据表现利好债市，而资产荒——其他大类资产几乎均录得负收益——也是债市的助攻，美债收益率在 4 季度下行，也打开了中国国债收益率的下行空间，中美摩擦的升级更是加剧了市场对 2019 年经济增长的担忧，所有这些因素都引爆了债券牛市。

报告期内，本基金规模保持稳定，进行了小仓位的利率债操作，并卖出大比例利率债，买入短久期高资质信用债，组合久期保持在较低位置。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2018 年 10 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日，本基金 A 类净值增长率为 1.08%，业绩比较基准收益率为 2.91%，低于业绩比较基准 1.83%；本基金 C 类净值增长率为 3.99%，业绩比较基准收益率为 2.91%，高于业绩比较基准 1.08%。

#### 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	1,898,601,311.60	98.40
	其中：债券	1,798,592,311.60	93.22
	资产支持证券	100,009,000.00	5.18
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	3,384,552.67	0.18



8	其他资产	27,436,259.16	1.42
9	合计	1,929,422,123.43	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	545,226,030.00	37.65
	其中：政策性金融债	545,226,030.00	37.65
4	企业债券	49,908,761.60	3.45
5	企业短期融资券	972,273,830.00	67.13
6	中期票据	15,522,550.00	1.07
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	215,661,140.00	14.89
9	其他	-	-
10	合计	1,798,592,311.60	124.19

## 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	050203	05 国开 03	2,500,000	255,400,000.00	17.63
2	180207	18 国开 07	1,100,000	110,264,000.00	7.61
3	100204	10 国开 04	1,000,000	98,950,000.00	6.83
4	111819314	18 恒丰银行 CD314	982,000	94,537,140.00	6.53
5	011802040	18 日照港 SCP007	800,000	80,352,000.00	5.55

## 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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	156081	18 建花 3A	300,000	29,988,000.00	2.07
2	1889411	18 钱江 1A	200,000	20,050,000.00	1.38
3	149864	18 花 15A1	200,000	19,992,000.00	1.38
4	156194	18 花呗 8A	100,000	9,997,000.00	0.69
5	156245	18 花呗 9A	100,000	9,991,000.00	0.69
6	139275	蚁信 06A	100,000	9,991,000.00	0.69
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

## 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

本基金所持有 18 恒丰银行 CD314 (111819314. IB)，发行人恒丰银行股份有限公司（以下简称“恒丰银行”），受到行政处罚，具体处罚如下。

于 2018 年 11 月 2 日，恒丰银行收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚决定，罚款 75 万元。主要违法违规事实：内控管理不审慎；企业信贷资金用途管理不到位。

于 2018 年 10 月 12 日，恒丰银行收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚决定，罚款 35 万元。主要违法违规事实：贸易背景真实性审查不审慎。

于 2018 年 9 月 29 日，恒丰银行收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚决定，罚款 35

元。主要违法违规事实：银行承兑汇票业务贸易背景审查不严格、违规办理银行承兑汇票业务。

于 2018 年 9 月 05 日，恒丰银行收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚决定，罚款 35 万元。主要违法违规事实：银行承兑汇票贴现资金回流出票人账户用作开立银行承兑汇票保证金。

于 2018 年 8 月 8 日，恒丰银行收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚决定，罚款 155 万元。主要违法违规事实：（一）违法违规办理票据业务员。（二）内控管理失控严重违反审慎经营规则。（三）内控管理不到位严重违反审慎经营规则。（四）对支行内控管理失控严重违反审慎经营规则未进行有效监督。

于 2018 年 6 月 21 日，恒丰银行收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚决定，罚款 80 万元。主要违法违规事实：违规办理无真实贸易背景的银行承兑汇票、采取不正当手段违规发放贷款。

于 2018 年 5 月 24 日，恒丰银行收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚决定，罚款 150 万元。主要违法违规事实：违法违规办理商业承兑汇票转贴现业务。

于 2018 年 2 月 07 日，恒丰银行收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚决定，罚款 48 万元。主要违法违规事实：（一）违法违规办理无真实贸易背景银行承兑汇票，严重违法审慎经营原则。

于 2018 年 2 月 07 日，恒丰银行收到中国银行保险监督管理委员会对梁珉藏、李泱的行政处罚决定，各罚款 6 万元。主要违法违规事实：对恒丰银行股份有限公司南充分行违法违规办理无真实贸易背景银行承兑汇票的行为负直接管理责任。

于 2018 年 2 月 07 日，恒丰银行收到中国银行保险监督管理委员会对罗四新的行政处罚决定，罚款 7 万元。主要违法违规事实：对恒丰银行股份有限公司南充分行违法违规办理无真实贸易背景银行承兑汇票的行为负主要领导责任。

于 2018 年 1 月 22 日，恒丰银行收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚决定，罚款 70 元。主要违法违规事实：虚增存贷款、信贷资金入市。

于 2018 年 1 月 16 日，恒丰银行收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚决定，罚款 60 万元。主要违法违规事实：违规办理票据业务。

于 2018 年 1 月 16 日，恒丰银行收到中国银行保险监督管理委员会对潘光健、李德才的行政处罚决定，各罚款 5 万元。主要违法违规事实：对恒丰银行股份有限公司达州分行未尽职审查银行承兑汇票贸易背景真实性，严重违法审慎经营规则行为负有直接责任。

于 2018 年 1 月 16 日，恒丰银行收到中国银行保险监督管理委员会对唐勇、张桂兴的行政处罚决定，分别罚款 6、7 万元。主要违法违规事实：对恒丰银行股份有限公司达州分行未尽职审查

银行承兑汇票贸易背景真实性、未监督贷款资金按约定用途使用严重违反审慎经营规则行为负有直接责任。

银行承兑汇票贸易背景真实性，严重违反审慎经营规则行为负有直接责任。

于 2018 年 1 月 16 日，恒丰银行收到中国银行保险监督管理委员会对彭清泉的行政处罚决定，警告、罚款 5 万元。主要违法违规事实：对恒丰银行股份有限公司达川支行未监督贷款资金按约定用途使用，严重违反审慎经营规则行为负有直接责任。

于 2017 年 12 月 11 日，恒丰银行收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚决定，罚款 50 元。主要违法违规事实：存贷挂钩。

于 2017 年 10 月 13 日，恒丰银行收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚决定，罚款 50 万元。主要违法违规事实：办理无真实贸易背景的银行承兑汇票业务。本基金所持有 18 天津农村商业银行 CD073（111895385. IB），发行人天津农村商业银行股份有限公司（以下简称“天津农村商业银行”），受到行政处罚。

于 2018 年 5 月 11 日，天津农村商业银行收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚决定，罚款 30 万元。主要违法违规事实：未依法履行其他职责。

本基金所持有 18 阳煤 CP005（041800420. IB）于 2018 年 7 月 31 日对外公告了收到行政监管措施决定书的事宜。阳泉煤业(集团)有限责任公司（以下简称“公司”）于 2018 年 7 月 31 日发布公告，公告称，公司近日收到中国证券监督管理委员会山西证监局对旗下子公司阳煤化工股份有限公司（以下简称“阳煤化工”）下达的行政监管措施决定书《关于对阳煤化工股份有限公司采取责令改正措施的决定》（〔2018〕第 8 号），主要原因有二，其一，2017 年度阳煤化工部分关联采购金额超过 2016 年经审计净资产的 5%，未在日常关联交易中预计，未单独履行审议程序并披露，且 2017 年年报披露不完整，其二，截止 2016 年 12 月 31 日，阳煤化工未弥补亏损金额超过实收股本总额 1/3，未按规定在事实发生之日起 2 个月内召开临时股东大会对该事项进行审议，规范运作不到位。阳煤化工已于 2018 年 8 月 15 日召开第三次临时股东大会，对议案进行审议。

本基金所持有 18 陕投集团 CP001（041800379. IB）、18 陕投集团 SCP001（011801921. IB），发行人陕西投资集团有限公司（以下简称“公司”），对外公告了收到行政监管措施书的事宜。

（1）公司于 2018 年 6 月 6 日发布公告，公告称，公司的三级子公司，西部证券股份有限公司（以下简称“西部证券”），于 2018 年 6 月 1 日收到中国证券监督管理委员会陕西监管局出具的行政监管措施事先告知书《限制业务活动、责令限期改正并处分有关责任人员事先告知书》（中国证券监督管理委员会陕西监管局行政监管措施事先告知书〔2018〕2 号）。

（2）公司于 2018 年 6 月 21 日发布公告，公告称，公司的三级子公司，西部证券，于 2018

年 6 月 15 日收到中国证券监督管理委员会陕西监管局出具的行政监管措施决定书《关于对西部证券股份有限公司采取限制业务活动、责令期限改正并处分有关责任人员措施的决定》（陕证监措施字（2018）8 号）。经陕西证监局调查，西部证券存在以下违规行为，分别违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条、《证券公司和证券投资基金公司合规管理办法》（证监令第 133 条）第六十一条、《证券公司治理准则》（证监会公告（2012）41 号）第六十一条、《证券公司分支机构监管规定》（证监会公告（2013）17 号）第十五条、《证券公司内部控制指引》（证监机构字（2003）260 号）第七条、第十六条、第二十条、第五十九条、第九十九条、《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第 113 号）第四条、第四十九条的规定，根据《证券公司监督管理条例》第七十条规定，采取监督管理措施。针对陕西证监局的行政监管措施，公司将进一步督促西部证券按照监管要求积极整改，促进其各项业务合规开展。截止目前，公司经营状况正常。

（3）公司于 2018 年 8 月 29 日发布公告，公告称，公司于 2018 年 8 月 27 日收到中国证券监督管理委员会陕西监管局出具的《关于对陕西投资集团有限公司采取出具警示函措施的决定》（陕证监措施字（2018）16 号）。经陕西证监局调查，公司违反了《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第 113 号），具体如下：1. 募集资金专户使用不规范、2. 部分募集资金未用于核准用途、3. 重大事项披露不及时。针对陕西证监局的行政监管措施，公司将进一步加强自查整改，促进各项业务合规开展。截止目前，公司经营状况正常。

#### 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 18 恒丰银行 CD314 (111819314. IB) 主要基于以下原因:

18 恒丰银行 CD314 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。

恒丰银行股份有限公司是 12 家全国性股份制商业银行之一，注册地烟台。近年来，恒丰银行稳健快速发展。截至 2016 年末，恒丰银行资产规模已突破 1.2 万亿元，是 2013 年末的 1.6 倍；存款余额 7578 亿元，贷款余额 4252 亿元，均比 2013 年末翻了一番。2014 年至 2016 年累计利润总额 312.17 亿元，这三年的累计利润总额为以往 26 年的累计利润总额；服务组织架构不断完善，分支机构数 306 家，是 2013 年末的两倍。近年来，恒丰银行屡获荣誉。在英国《银行家》杂志发布的“2016 全球银行 1000 强”榜单中排名第 143 位；在香港中文大学发布的《亚洲银行竞争力研究报告》中位列亚洲银行业第 5 位；在中国银行业协会发布的“商业银行稳健发展能力‘陀螺(GYROSCOPE)评价体系’”中，综合能力排名位列全国性商业银行第 7 位，全国性股份制商业银行前三；荣获“2016 老百姓最喜欢的股份制商业银行”第二名、“2016 年互联网金融创新银行奖”、“2016 年最佳网上银行安全奖”、“2016 年度创新中国特别奖”等多项荣誉。

本基金投资 18 天津农村商业银行 CD073 (111895385. IB) 主要基于以下原因:

18 天津农村商业银行 CD073 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。

天津农村商业银行股份有限公司（简称“天津农商银行”）的前身是有着 60 多年发展历史的农村信用社。2010 年 6 月，天津农商银行正式改制挂牌成立。秉承“持续发展的、区域领先的、专注于三农和中小企业的社区型零售银行”的发展愿景，天津农商银行在着力推进传统优势业务

发展的同时，全面拓展电子银行、投资银行等新型业务，初步形成了符合现代股份制商业银行特点的业务链条，总资产、存款、贷款等主要经营指标均保持良好的增长势头。截至 2016 年末，全行总资产达到 3037.9 亿元，同比增长 18.7%，各项存款余额 2139.2 亿元，增长 13.3%，各项贷款余额 1375.6 亿元，增长 10.1%。在中国银监会监管评级中，被评为二级行，在英国《银行家》杂志公布的 2016 年全球银行 1000 强排名中，位居第 307 位，较成立之初提升了 182 位，市场地位显著提升。近年来，天津农商银行风险管控及支持保障体系建设全面推进，品牌形象和服务品质显著提升，员工队伍结构和素质实现全面强化，综合实力显著增强，核心竞争力进一步彰显，现代化商业银行已颇具雏形。“发展未有穷期，奋斗永不言止”。天津农商银行将驭时代东风，创宏图伟业，在建设现代股份制商业银行的征程上，全力迈出新步伐，争创新业绩，实现新跨越。

本基金投资 18 阳煤 CP005 主要基于以下原因：

阳泉煤业(集团)有限责任公司是全国最大的无烟煤生产基地和喷吹煤加工基地之一，具有较大的市场占有率和影响力。作为煤炭行业首家注册商标的煤炭企业，“阳优”品牌已经取得了良好的品牌效应。公司已通过 ISO9000—14000 质量体系认证和山西省技术监督局的质量认证。公司煤炭产品优质稳定，行销全国 15 个省市、100 多个用户，出口日本、韩国、巴西、比利时等国，销量逐年递增。冶金用煤国内主要供应鞍钢、首钢、唐钢、本钢等国内重点大型钢铁企业，出口到日本新日铁、NKK、住友金属、韩国浦项、德国克虏伯等世界一流钢铁企业集团。

18 阳煤 CP005 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。

本基金投资 18 陕投集团 CP001、18 陕投集团 SCP001 主要基于以下原因：

公司主营：煤田地质、水文地质、矿产勘察的筹建；地质技术服务、地质灾害处理；测绘工程、工程勘察、地基与基础工程的施工；煤炭开采的筹建；电力、化工、矿业、新能源的开发；项目投资(仅限公司自有资金)；房地产开发与经营；酒店经营的筹建；贸易；铁路运销；省政府要求的对全省重点产业领域和重大发展项目的投资管理；煤炭批发经营。

18 陕投集团 CP001、18 陕投集团 SCP001 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

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。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	8,624.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,427,134.50
5	应收申购款	500.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,436,259.16

### 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	东方臻享纯债债券 A	东方臻享纯债债券 C
报告期期初基金份额总额	1,293,576,637.55	918,780,892.67
报告期期间基金总申购份额	4,967.74	11,882,941.37
减：报告期期间基金总赎回份额	-	919,720,967.00
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	1,293,581,605.29	10,942,867.04

## § 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	20181001-20181231	1,093,410,690.83	-	-	1,093,410,690.83	83.82%
	2	20181001-20181231	918,442,329.56	-	918,442,329.56	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-

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、《东方臻享纯债债券型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方臻享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](http://www.orient-fund.com)）查阅。

东方基金管理有限责任公司

2019 年 1 月 18 日