

东方双债添利债券型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年十月二十八日

§ 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 27 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 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东方双债添利债券
基金主代码	400027
交易代码	400027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 9 月 24 日
报告期末基金份额总额	1,105,469,292.32 份
投资目标	在适度承担信用风险并保持基金资产流动性的条件下，对固定收益类资产进行积极主动的投资管理，在此基础上通过个股精选配置权益类资产，实现基金资产长期、稳定的投资回报。
投资策略	本基金主要投资于债券市场，在严控投资风险的基础上，通过投资于股票市场提高投资收益。本基金紧密跟踪债券市场与股票市场的运行情况 and 风险收益特征，结合对宏观经济环境、国家政策趋向及利率变化趋势等重点分析，判断债券市场和股票市场的相对投资价值，在债券资产与股票资产之间进行动态调整。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%
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	东方基金管理股份有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	东方双债添利债券 A 类	东方双债添利债券 C 类
下属分级基金的交易代码	400027	400029
报告期末下属分级基金的份额总额	1,076,742,100.30 份	28,727,192.02 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（2020年7月1日—2020年9月30日）	
	东方双债添利债券 A 类	东方双债添利债券 C 类
1. 本期已实现收益	33,396,448.18	924,019.36
2. 本期利润	44,908,454.57	1,560,751.68
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0443	0.0537
4. 期末基金资产净值	1,395,653,995.75	37,158,683.34
5. 期末基金份额净值	1.2962	1.2935

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 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

东方双债添利债券 A 类

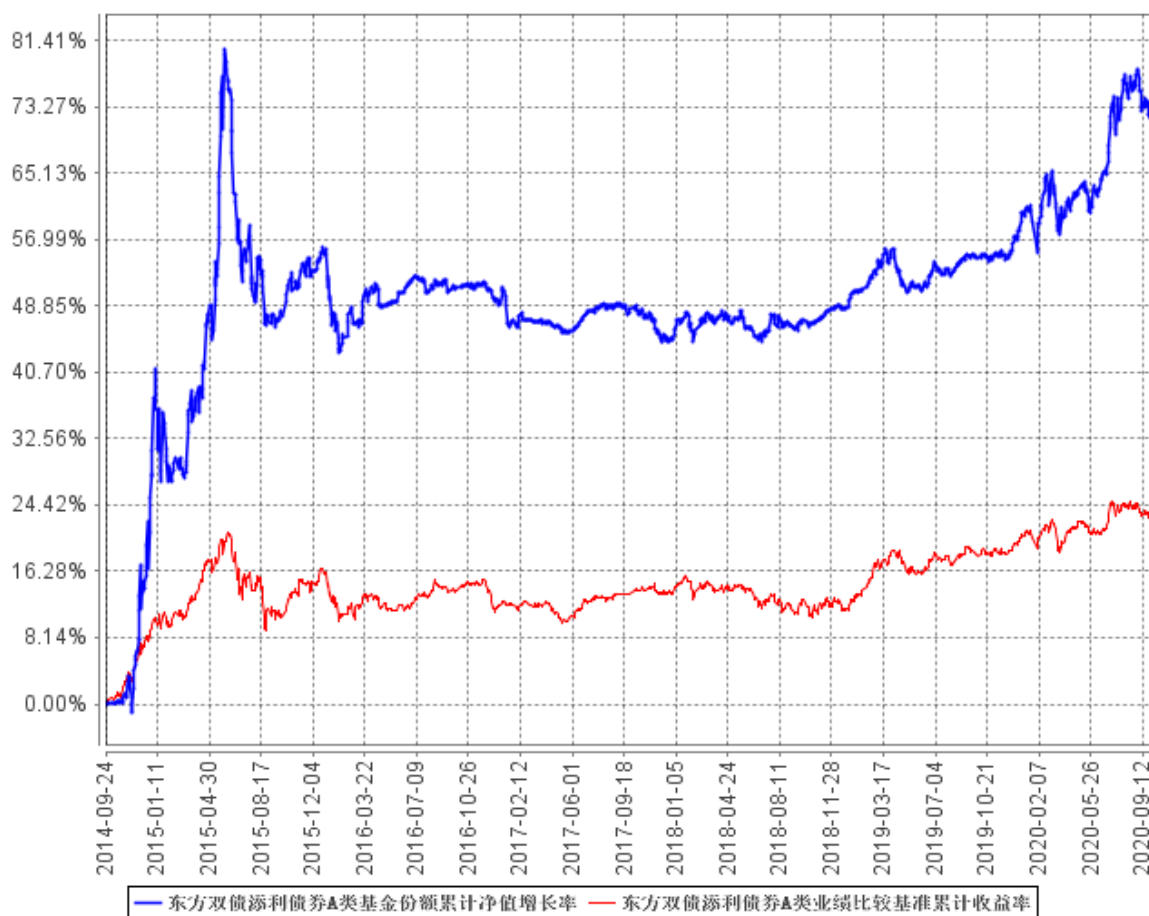
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.31%	0.60%	0.89%	0.30%	3.42%	0.30%
过去六个月	8.29%	0.51%	2.57%	0.26%	5.72%	0.25%
过去一年	11.91%	0.51%	4.10%	0.26%	7.81%	0.25%
过去三年	16.67%	0.34%	8.28%	0.26%	8.39%	0.08%
过去五年	17.33%	0.33%	11.00%	0.25%	6.33%	0.08%
自基金合同生效起至今	73.12%	0.65%	22.98%	0.31%	50.14%	0.34%

东方双债添利债券 C 类

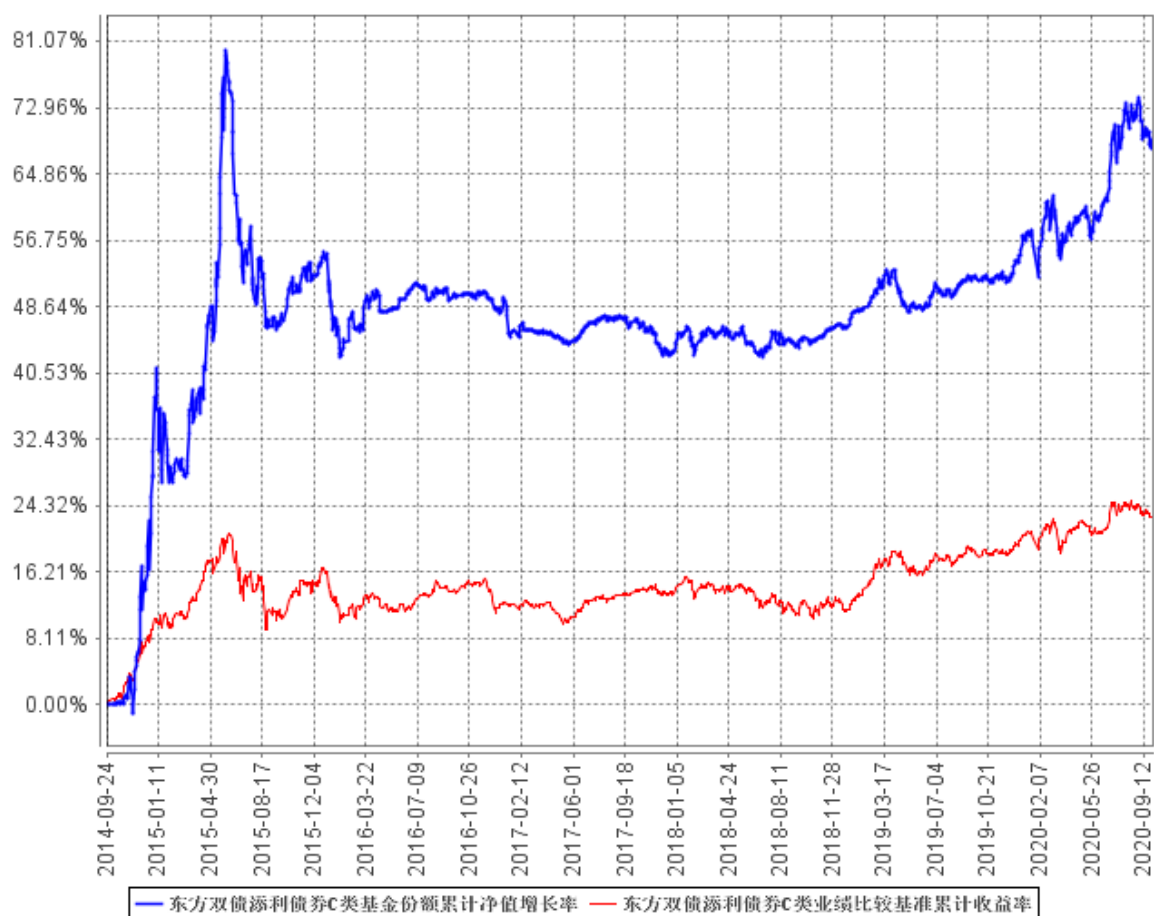
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准收 益率标准差④	①—③	②—④
过去三个 月	4.21%	0.60%	0.89%	0.30%	3.32%	0.30%
过去六个 月	8.08%	0.51%	2.57%	0.26%	5.51%	0.25%
过去一年	11.48%	0.51%	4.10%	0.26%	7.38%	0.25%
过去三年	15.40%	0.34%	8.28%	0.26%	7.12%	0.08%
过去五年	15.18%	0.33%	11.00%	0.25%	4.18%	0.08%
自基金合 同生效起 至今	69.30%	0.65%	22.98%	0.31%	46.32%	0.34%

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

东方双债添利债券A类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



东方双债添利债券C类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		
杨贵宾（先生）	本基金基金经理、公司副总经理、固定收益投资总监、投资决	2019年11月14日	-	15年	公司副总经理、固定收益投资总监、投资决策委员会委员。西安交通大学应用经济学博士，15年投资从业经历。曾任富国基金管理有限公司固定收益研究员、基金经理，上海海通证券资产管理有限责任公司投资主办、

	策委员会委员				固定收益投资总监、公司总助职位。2019 年 9 月加盟本公司，曾任公司总经理助理，现任东方双债添利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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

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、《东方双债添利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的同向交易价差、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

2020 年三季度，新冠疫情对国内宏观经济的冲击趋于缓和，随着疫情企稳以及经济出现好转迹象，央行对于流动性开始实质性收紧。在此背景下，股市在季初也出现了一轮强劲上涨，但随后也出现一定回落。债市出现了明显调整，截至 9 月底资金利率和 10 年期国债收益率水平均超过疫情之前。

报告期间，本基金继续维持绝对收益、淡化排名、均衡配置、风险对冲指导思想。权益操作方面，随着国内疫情缓解和经济逐渐回暖，前期超配的医药食品饮料社服等大消费品种适度减持，小幅回补低估值的周期品种，周期非周期股票趋于均衡。转债方面，适度减持了部分高价转债，主要持有绝对价格较低的银行、电力转债，适度增持了白酒、券商、机械等优势行业转债。信用债方面，维持短久期高资质信用债仓位，再次增加了长端利率债用于对冲和平衡组合。从结果来看，由于股票行业选择较好，本基金在三季度收益表现基本满意。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2020 年 7 月 1 日起至 2020 年 9 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为 4.31%，业绩比较基准收益率为 0.89%，高于业绩比较基准 3.42%；本基金 C 类净值增长率为 4.21%，业绩比较基准收益率为 0.89%，高于业绩比较基准 3.32%。

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	268,984,980.46	15.40
	其中：股票	268,984,980.46	15.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,442,488,472.16	82.60
	其中：债券	1,442,488,472.16	82.60
	资产支持证券	-	-
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	6,274,983.92	0.36
8	其他资产	28,525,208.13	1.63
9	合计	1,746,273,644.67	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	22,380,837.50	1.56
C	制造业	187,736,362.96	13.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,455,550.00	1.08
J	金融业	14,228,800.00	0.99
K	房地产业	4,608,100.00	0.32
L	租赁和商务服务业	11,441,550.00	0.80
M	科学研究和技术服务业	8,903,580.00	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,534,200.00	0.11

R	文化、体育和娱乐业	2,696,000.00	0.19
S	综合	-	-
	合计	268,984,980.46	18.77

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	600585	海螺水泥	170,000	9,394,200.00	0.66
2	002027	分众传媒	965,000	7,787,550.00	0.54
3	600570	恒生电子	75,000	7,394,250.00	0.52
4	600547	山东黄金	283,225	7,222,237.50	0.50
5	300059	东方财富	240,000	5,757,600.00	0.40
6	600031	三一重工	220,000	5,475,800.00	0.38
7	601899	紫金矿业	850,000	5,227,500.00	0.36
8	601088	中国神华	300,000	4,941,000.00	0.34
9	002271	东方雨虹	90,000	4,851,000.00	0.34
10	603308	应流股份	170,000	4,785,500.00	0.33

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	129,924,065.60	9.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	102,598,621.20	7.16
	其中：政策性金融债	102,598,621.20	7.16
4	企业债券	359,815,309.50	25.11
5	企业短期融资券	60,174,000.00	4.20
6	中期票据	282,132,000.00	19.69
7	可转债（可交换债）	507,844,475.86	35.44
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,442,488,472.16	100.68

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	019536	16 国债 08	660,840	63,559,591.20	4.44
2	019547	16 国债 19	637,520	58,951,474.40	4.11
3	101754009	17 淮安开发	400,000	41,076,000.00	2.87

		MTN001			
4	012000208	20 大同煤矿 SCP003	400,000	40,208,000.00	2.81
5	018009	国开 1803	330,000	35,927,100.00	2.51

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金所持有三一重工[600031.SH]，发行人三一重工股份有限公司（以下简称“公司”）受到处罚。经查明，李京京于 2016 年 6 月 29 日至 2019 年 8 月 31 日担任三一重工股份有限公司（以下简称公司）副总裁。李京京合计减持公司股份达到 27.2 万股，超过前期减持预披露计划 9 万股；同时，作为公司时任副总裁，李京京当年合计减持公司股份数量超出其所持有公司股份总数的 25%。公司时任副总裁李京京实际减持股份数量超过前期减持计划上限，违反了《公司法》关于高级管理人员在任职期间每年转让股份不得超过其所持有公司股份总数 25%的相关规定。对于超额减持部分，李京京未按照规定在减持的 15 个交易日前披露减持计划。鉴于上述违规事实和情节，经上海证券交易所（以下简称本所）纪律处分委员会审核通过，根据《股票上市规则》第 17.3 条和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》等相关规定，本所做出如下纪律处分决定：对三一重工股份有限公司时任副总裁李京京予以通报批评。上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金所持有的东方财富(300059)，因未依法履行其他职责，被中国证券监督管理委员会上

海监管局责令改正。具体违规行为：上海东方财富证券投资咨询有限公司在开展证券投资顾问业务过程中，一是未对部分投资者进行适当性评估并提出适当性匹配意见；二是提供证券投资顾问服务前未与个别客户签订证券投资顾问服务协议；三是对客户进行不实、误导性营销宣传；四是内部控制不健全。上述行为违反了《证券期货投资者适当性管理办法》第三条、第二十九条第一款及《证券投资顾问业务暂行规定》（证监会公告[2010]27号）第三条、第十一条、第十四条第一款、第二十四条的规定。根据《证券期货投资者适当性管理办法》第三十七条及《证券投资顾问业务暂行规定》第三十三条的规定，上海监管局决定对公司采取责令改正的监督管理措施。要求公司按照相关法律、行政法规和中国证监会规定的要求落实整改，完善内部控制，切实提高合规管理水平。

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。

本基金投资三一重工主要基于以下原因：

三一重工公司是全球装备制造业领先企业之一。机械建筑业务稳步扩张，市占率稳步提升，第三方基金销售业务受益于居民对财富配置需求的增加，公司业务仍处于快速成长阶段。

本基金投资东方财富主要基于以下原因：

东方财富是国内领先的互联网金融服务平台，经纪业务、两融业务稳步扩张，市占率稳步提升，第三方基金销售业务受益于居民对财富配置需求的增加，公司业务仍处于快速成长阶段。

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	180,267.41
2	应收证券清算款	11,092,808.87
3	应收股利	-
4	应收利息	17,251,732.16
5	应收申购款	399.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,525,208.13

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	29,158,350.00	2.04
2	110053	苏银转债	19,067,920.00	1.33
3	113029	明阳转债	14,119,350.00	0.99

4	127006	敖东转债	13,768,584.15	0.96
5	128064	司尔转债	13,113,527.32	0.92
6	110055	伊力转债	12,419,000.00	0.87
7	128035	大族转债	12,220,410.33	0.85
8	113013	国君转债	11,869,890.00	0.83
9	110043	无锡转债	10,656,150.00	0.74
10	123033	金力转债	10,621,872.63	0.74
11	123010	博世转债	9,602,595.53	0.67
12	110067	华安转债	9,019,880.00	0.63
13	113563	柳药转债	8,163,390.00	0.57
14	110061	川投转债	7,856,641.10	0.55
15	113508	新风转债	7,526,300.00	0.53
16	123039	开润转债	7,520,312.76	0.52
17	128034	江银转债	7,314,760.00	0.51
18	113559	永创转债	6,788,540.00	0.47
19	113564	天目转债	6,415,240.00	0.45
20	128026	众兴转债	6,410,880.00	0.45
21	113030	东风转债	6,322,400.00	0.44
22	128019	久立转 2	6,196,491.28	0.43
23	113516	苏农转债	6,000,390.00	0.42
24	110057	现代转债	5,999,600.00	0.42
25	123004	铁汉转债	5,940,919.53	0.41
26	127011	中鼎转 2	5,920,080.00	0.41
27	123028	清水转债	5,830,240.00	0.41
28	128025	特一转债	5,826,700.00	0.41
29	113025	明泰转债	5,562,500.00	0.39
30	113528	长城转债	5,128,000.00	0.36
31	128081	海亮转债	4,994,880.00	0.35
32	128101	联创转债	4,375,018.74	0.31
33	113530	大丰转债	4,189,768.00	0.29
34	128085	鸿达转债	4,181,901.66	0.29
35	110058	永鼎转债	4,072,950.00	0.28
36	113534	鼎胜转债	3,762,802.40	0.26
37	110065	淮矿转债	3,594,624.00	0.25
38	128094	星帅转债	3,371,986.56	0.24
39	128069	华森转债	3,209,913.98	0.22
40	128076	金轮转债	3,140,100.00	0.22
41	113535	大业转债	2,932,051.00	0.20
42	128022	众信转债	2,791,920.00	0.19

43	123007	道氏转债	2,790,811.17	0.19
44	113553	金牌转债	2,677,200.00	0.19
45	123024	岱勒转债	2,675,250.00	0.19
46	113568	新春转债	2,640,500.00	0.18
47	128070	智能转债	2,506,800.00	0.17
48	128075	远东转债	2,330,820.00	0.16
49	113502	嘉澳转债	2,320,470.00	0.16
50	113014	林洋转债	2,191,800.00	0.15
51	128042	凯中转债	2,141,600.00	0.15
52	113570	百达转债	2,137,400.00	0.15
53	113561	正裕转债	1,988,820.00	0.14
54	113541	荣晟转债	1,935,040.00	0.14
55	128049	华源转债	1,895,160.00	0.13
56	123011	德尔转债	1,661,280.00	0.12
57	128033	迪龙转债	1,659,253.20	0.12
58	113557	森特转债	1,618,500.00	0.11
59	110051	中天转债	1,555,060.00	0.11
60	113572	三祥转债	1,493,180.00	0.10
61	113524	奇精转债	1,402,625.40	0.10
62	128051	光华转债	1,154,700.00	0.08
63	113536	三星转债	1,153,900.00	0.08
64	113567	君禾转债	1,123,200.00	0.08
65	128066	亚泰转债	1,116,800.00	0.08
66	128046	利尔转债	1,101,060.00	0.08
67	113519	长久转债	1,081,400.00	0.08
68	128093	百川转债	1,075,800.00	0.08
69	123023	迪森转债	1,031,012.16	0.07
70	123035	利德转债	985,280.00	0.07
71	113542	好客转债	924,720.00	0.06
72	123045	雷迪转债	919,120.00	0.06
73	128087	孚日转债	897,750.00	0.06
74	113569	科达转债	817,445.20	0.06
75	128098	康弘转债	808,227.00	0.06
76	128082	华锋转债	777,140.00	0.05
77	128014	永东转债	716,660.00	0.05
78	113545	金能转债	715,046.00	0.05
79	128071	合兴转债	634,750.00	0.04
80	110041	蒙电转债	617,485.00	0.04
81	128015	久其转债	605,820.00	0.04

82	128058	拓邦转债	479,958.70	0.03
83	113012	骆驼转债	466,781.60	0.03
84	128057	博彦转债	458,406.58	0.03
85	128023	亚太转债	380,960.00	0.03
86	128056	今飞转债	354,360.00	0.02
87	128083	新北转债	331,530.00	0.02
88	128037	岩土转债	292,710.00	0.02
89	128095	恩捷转债	284,152.08	0.02
90	113525	台华转债	232,260.00	0.02
91	127014	北方转债	217,460.00	0.02
92	123047	久吾转债	169,826.80	0.01

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600547	山东黄金	7,222,237.50	0.50	临时停牌

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方双债添利债券 A 类	东方双债添利债券 C 类
报告期期初基金份额总额	876,901,531.32	29,991,746.49
报告期期间基金总申购份额	223,737,921.73	839,494.86
减：报告期期间基金总赎回份额	23,897,352.75	2,104,049.33
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	1,076,742,100.30	28,727,192.02

§ 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

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 一、《东方双债添利债券型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方双债添利债券型证券投资基金托管协议》
- 三、东方基金管理股份有限公司批准成立批件、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）查阅。

东方基金管理股份有限公司

2020 年 10 月 28 日