

东方多策略灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年七月二十一日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 20 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 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东方多策略灵活配置混合	
基金主代码	400023	
交易代码	400023	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 5 月 21 日	
报告期末基金份额总额	40,396,789.65 份	
投资目标	在严控风险的前提下，结合灵活的资产配置和多种投资策略，充分把握市场机会，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金通过对类别资产的灵活配置，调整不同时期内基金的整体风险与收益水平，并结合多种投资策略精选具有较高投资价值的股票和债券，获得基金的长期稳定增值。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中债总指数收益率×30%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。	
基金管理人	东方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东方多策略灵活配置混合 A	东方多策略灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	400023	002068
报告期末下属分级基金的份额总额	3,794,965.34 份	36,601,824.31 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（2021年4月1日—2021年6月30日）	
	东方多策略灵活配置混合 A	东方多策略灵活配置混合 C
1. 本期已实现收益	76,063.67	1,035,633.11
2. 本期利润	400,916.74	5,572,763.26
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0996	0.1477
4. 期末基金资产净值	4,701,950.18	68,092,651.76
5. 期末基金份额净值	1.2390	1.8604

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

东方多策略灵活配置混合 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	8.85%	1.01%	2.62%	0.69%	6.23%	0.32%
过去六个月	2.88%	1.51%	0.46%	0.92%	2.42%	0.59%
过去一年	2.76%	1.31%	17.49%	0.93%	-14.73%	0.38%
过去三年	10.43%	0.76%	35.80%	0.95%	-25.37%	-0.19%
过去五年	14.34%	0.60%	45.68%	0.82%	-31.34%	-0.22%
自基金合同生效起至今	42.81%	0.51%	101.94%	1.04%	-59.13%	-0.53%

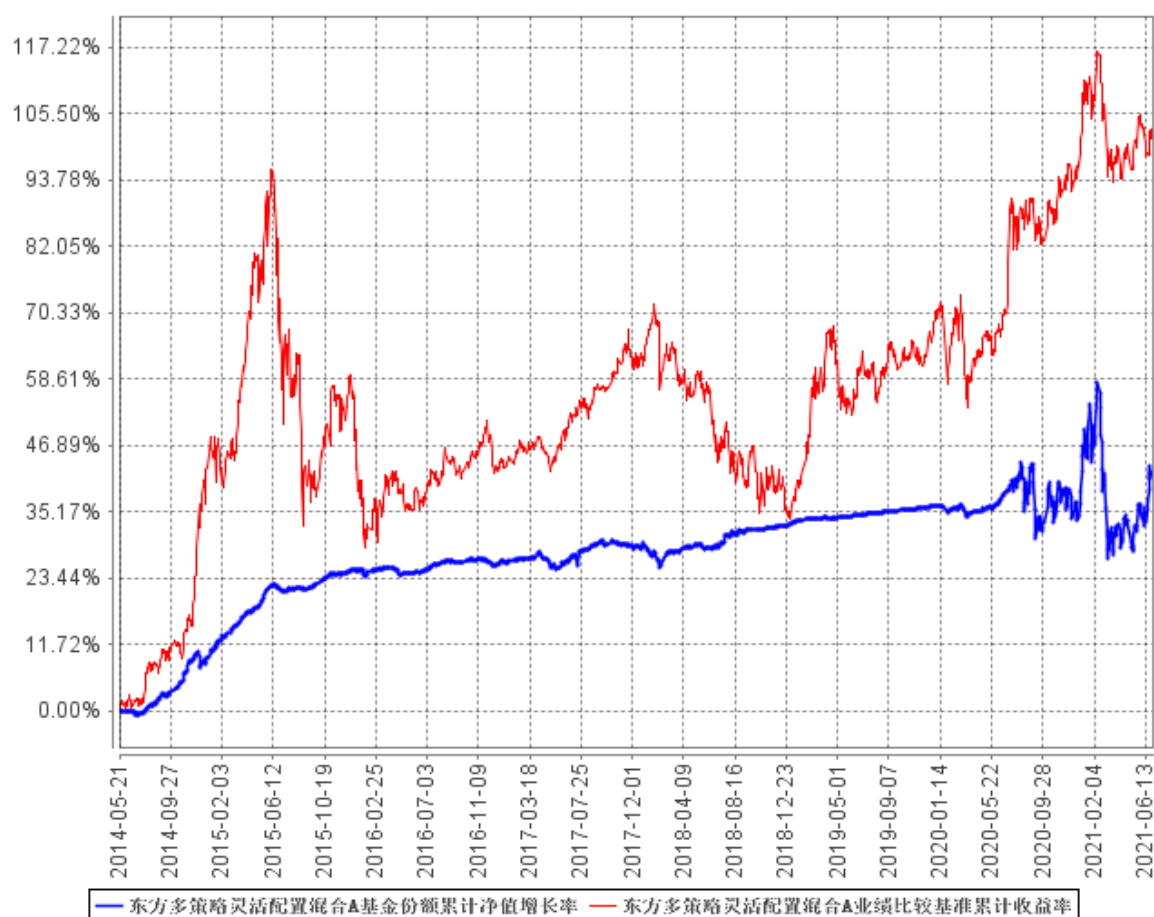
东方多策略灵活配置混合 C

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	8.80%	1.01%	2.62%	0.69%	6.18%	0.32%

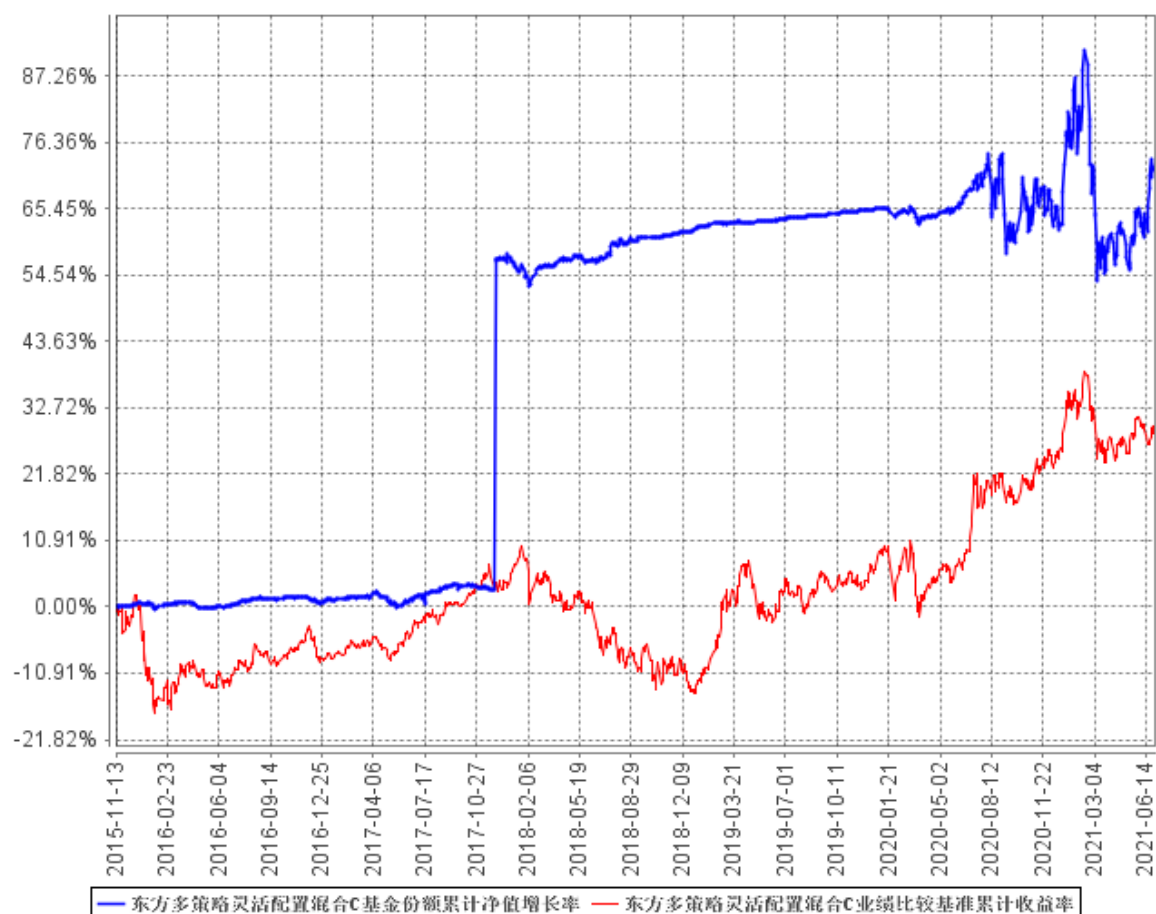
过去六个月	2.78%	1.51%	0.46%	0.92%	2.32%	0.59%
过去一年	2.56%	1.31%	17.49%	0.93%	-14.93%	0.38%
过去三年	9.82%	0.76%	35.80%	0.95%	-25.98%	-0.19%
过去五年	72.45%	1.63%	45.68%	0.82%	26.77%	0.81%
自基金合同生效起至今	72.97%	1.53%	29.24%	0.88%	43.73%	0.65%

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

东方多策略灵活配置混合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



东方多策略灵活配置混合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		
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、公募投	2020年7月31日	—	16年	公司副总经理、固定收益投资总监、公募投资决策委员会副主任委员。西安交通大学应用经济学博士，16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

	资 策 委 员 会 副 主 任 委 员				司投资主办、固定收益投资 总监、公司总助职位。2019 年 9 月加盟本基金管理人， 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、东方可 转债债券型证券投资基金 基金经理。
车日楠（女 士）	本 基 金 基 金 经 理	2020 年 5 月 11 日	2021 年 6 月 17 日	6 年	北京交通大学计算数学专 业硕士，6 年证券从业经历。 2015 年 7 月加盟本基金管 理人，曾任固定收益研究部 研究员、交易部债券交易员， 东方永泰纯债 1 年定期开放 债券型证券投资基金基金 经理助理、东方臻选纯债债 券型证券投资基金基金经 理助理、东方永兴 18 个月 定期开放债券型证券投资 基金基金经理助理、东方稳 健回报债券型证券投资基 金基金经理助理、东方成 长回报平衡混合型证券投资 基金基金经理助理、东方添 益债券型证券投资基金基 金经理助理、东方臻享纯 债债券型证券投资基金基 金经理助理、东方价值挖 掘灵活配置混合型证券投资 基金基金经理助理、东方多 策略灵活配置混合型证券 投资基金基金经理，现任东 方臻选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、东方臻萃 3 个 月定期开放纯债债券型证 投资基金基金经理、东方永 悦 18 个月定期开放纯债 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。

4.1.1 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、《东方多策略灵活配置混合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

2021 年二季度，全球经济继续走在复苏的路上，尽管局部疫情还有反复，但中国、欧美等主要经济体疫苗注射进展顺利，经济数据继续向好。不过，随着去年基数的逐渐太高，各项经济同比数据开始出现预期之内的回落。同时，大宗商品价格涨势趋缓，通胀预期有所回落。

二季度美债收益率出现小幅回落，市场对美联储收紧货币政策的预期也有所缓解。在此背景下，美股续创新高，A 股也走出震荡上行走势，基本收复一季度失地，但整体走势较弱且结构分化较为严重。除新能源、新能源车、半导体、医药等少数行业外，A 股多数行业走势疲弱，赚钱效应较差。

个人认为，未来经济格局将是增速相对欧美日仍快但趋势缓步下行，消费保持稳定，制造业重要性再次得到重视（疫情下强大的制造能力成为经济稳定基础、外围制裁封锁要求我们保证自己制造业链条完整），出口仍将保持稳定增长，通胀稳中有降。

报告期间，多策略继续均衡配置、风险对冲指导思想。维持之前较高仓位、均衡配置的风格，行业上大幅降低了周期板块，适度降低消费板块，同时增加了先进制造等科技板块，大消费（食品饮料医药社服）、科技（TMT 先进制造）和周期（机械建材券商）大致 45:45:10 的配置比例。此外，持有少量双低可转债，维持较高比例长端利率债用于对冲和平衡组合波动。

多策略的投资思想为：满仓持有中国优秀的朝阳行业股票和稳定的大消费类股票，长期与中国优秀企业长期为伍，赚企业自身成长带来的收益，承受一定估值溢价和波动性。从净值表现结果来看，二季度多策略净值表现略好，但仍低于预期。个人之前的许多绝对收益投资习惯在相对排名为主的公募行业中有所不适，花了不少精力和代价来调整。

随着市场风格不再过于偏执，相对平稳的市态较为适合我的操作风格。多策略组合中无论是股票还是可转债，有不少仓位都是慢热品种，会在风格平稳时逐渐释放。个人对多策略的持仓满怀信心，以平常心去静候花开。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2021 年 4 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为 8.85%，业绩比较基准收益率为 2.62%，高于业绩比较基准 6.23%；本基金 C 类净值增长率为 8.80%，业绩比较基准收益率

为 2.62%，高于业绩比较基准 6.18%。

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	66,374,235.59	72.12
	其中：股票	66,374,235.59	72.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	24,503,734.73	26.63
	其中：债券	24,503,734.73	26.63
	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	278,815.05	0.30
8	其他资产	873,876.63	0.95
9	合计	92,030,662.00	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	-	-
C	制造业	44,914,686.50	61.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,360,463.70	7.36
E	建筑业	11,014.44	0.02
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	6,716,530.40	9.23
J	金融业	1,672,257.21	2.30
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,070,200.00	2.84
M	科学研究和技术服务业	1,577,140.00	2.17
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	3,022,943.34	4.15
R	文化、体育和娱乐业	1,029,000.00	1.41
S	综合	-	-
	合计	66,374,235.59	91.18

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	600905	三峡能源	907,763	5,355,801.70	7.36
2	002027	分众传媒	220,000	2,070,200.00	2.84
3	600298	安琪酵母	35,988	1,957,027.44	2.69
4	300673	佩蒂股份	85,500	1,903,230.00	2.61
5	600570	恒生电子	20,000	1,865,000.00	2.56
6	603899	晨光文具	22,000	1,860,320.00	2.56
7	600519	贵州茅台	900	1,851,030.00	2.54
8	600110	诺德股份	145,000	1,766,100.00	2.43
9	603501	韦尔股份	5,400	1,738,800.00	2.39
10	688002	睿创微纳	17,000	1,697,110.00	2.33

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

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	20,382,150.00	28.00

2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,807,925.00	3.86
	其中：政策性金融债	2,807,925.00	3.86
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,313,659.73	1.80
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,503,734.73	33.66

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	019547	16 国债 19	190,000	17,896,100.00	24.58
2	108802	进出 1902	20,000	2,000,600.00	2.75
3	170001	17 付息国债 01	15,000	1,504,350.00	2.07
4	019536	16 国债 08	10,000	981,700.00	1.35
5	113598	法兰转债	6,000	647,340.00	0.89

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股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

本基金所持有的睿创微纳（688002）于 2020 年 10 月 15 日公告，烟台睿创微纳技术股份有限公司（以下简称公司）时任董事、副总经理、董事会秘书兼财务总监赵芳彦披露减持计划公告，拟自 2020 年 8 月 22 日至 2021 年 2 月 10 日期间，通过集中竞价方式减持不超过 1,000,000 股。减持前，赵芳彦持有公司股票 4,675,325 股，占公司股份总数的 1.05%。2020 年 9 月 29 日，赵芳彦通过集中竞价交易卖出公司股票合计 80,000 股，成交均价为 85.015 元/股，成交金额 6,801,200 元。公司首次预约 2020 年第三季度报告披露日期为 2020 年 10 月 28 日，上述交易系在定期报告披露前 30 日内减持公司股票，构成窗口期违规买卖股票行为。另经查明，赵芳彦已提前终止本次股份减持计划，并向公司缴纳 50 万元罚款。同时，赵芳彦因违规减持公司股票对公司造成负面影响，申请辞去公司董事会秘书职务。

公司公告以上内容不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的贵州茅台（600519）于 2020 年 12 月 31 日公告，公司时任董事董事长高卫东被上交所予以监管关注。主要内容为“经查明，2020 年 12 月 16 日，贵州茅台酒股份有限公司（以下简称贵州茅台或公司）召开 2020 年度贵州茅台酱香系列酒全国经销商联谊会。会议上公司董事长高卫东表示，公司 2020 年预计可完成酱香系列酒销量 2.95 万吨，实现含税销售额 106 亿元，同比增长 4%。同时，多家媒体对会议内容进行报道，引发了市场和投资者的广泛关注。近期，白酒板块上市公司受到投资者及媒体的广泛关注，相关公司的产销情况及业绩信息是市场高度关注的热点信息，可能对公司股票交易及投资者决策产生较大影响。高卫东作为公司时任董事长，通过非法定信息披露渠道自行对外发布涉及公司经营的重要信息。鉴于上述违规事实和情节，根据《股票上市规则》第 17.1 条和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》有关规定，我部做出如下监管措施决定：对贵州茅台酒股份有限公司时任董事长高卫东予以监管关注。”

公司公告以上内容不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的韦尔股份（603501）公司因业务违规受到上海证监局决定对公司采取出具警示函的监管措施。公司目前经营一切正常，上述处罚不会对正常经营造成影响。公司 2021 年 5 月 6 日公告关于收到中国证监会上海证监局警示函的公告，主要内容为：“你公司（统一社会信

用代码：9131000066244468X3)于 2019 年 1 月 17 日完成深圳市芯能投资有限公司（以下简称“芯能投资”）、深圳市芯力投资有限公司（以下简称“芯力投资”）100%股权的收购，收购价款合计 16.87 亿元。其中，芯能投资、芯力投资主要资产分别为其持有的北京豪威科技有限公司 6.31% 股权、4.24% 股权。2019 年 7 月，你公司与兴业银行签订借款合同，借款金额为 10 亿元，借款期限为 2019 年 7 月 5 日至 2024 年 7 月 4 日，借款用途为用于支付（或置换）芯能投资和芯力投资 100% 股权的股权并购款。你公司以持有的芯能投资、芯力投资 100% 股权及芯能投资、芯力投资持有的北京豪威科技有限公司 10.55% 股权提供质押担保。上述质押资产的账面价值约占最近一期经审计总资产 37%。你公司对于上述资产质押情况未及时在临时公告中披露，直至 2020 年 4 月 10 日才在 2019 年年度报告中披露。上海证监局决定对公司采取出具警示函的监管措施。”

公司公告以上内容不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

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。

本基金投资睿创微纳主要基于以下原因：

公司是国内非制冷红外热成像与 MEMS 传感技术集成电路芯片的龙头企业，公司本身技术实力强并且从事的领域有较大发展潜力，其产品未来在军民两用方面有很大拓展空间。

本基金投资贵州茅台主要基于以下原因：

国内白酒行业出现弱复苏强分化特征，龙头企业集中度进一步提升，公司是国内白酒龙头，主打高端酒价位带，拥有绝对强的品牌壁垒，业绩表现良好、财务指标过硬。我们认为公司具备较宽的护城河，在国内白酒行业分化的背景之下，公司作为全国化高端龙头具备投资价值。

本基金投资韦尔股份主要基于以下原因：

公司作为 CIS 芯片行业龙头，客户在规模和质量方面均有较大优势，公司在 CIS 业务方面有强大的护城河，业务结构和公司业绩相对稳定，创新能力突出，具备一定投资价值。

5.11.2 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

本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	20,904.42
2	应收证券清算款	514,772.83
3	应收股利	-
4	应收利息	335,881.96
5	应收申购款	2,317.42
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	873,876.63

5.11.4 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	113598	法兰转债	647,340.00	0.89
2	123033	金力转债	391,410.00	0.54
3	128123	国光转债	115,350.69	0.16

5.11.5 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	600905	三峡能源	5,355,801.70	7.36	新股锁定限售

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方多策略灵活配置混合 A	东方多策略灵活配置混合 C
报告期期初基金份额总额	4,046,066.88	37,773,150.78
报告期期间基金总申购份额	343,886.45	5,593,735.23
减：报告期期间基金总赎回份额	594,987.99	6,765,061.70
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	3,794,965.34	36,601,824.31

§ 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	20210401 - 20210607 ; 20210616 - 20210630	8,692,906.67	-	-	8,692,906.67	21.52%
产品特有风险							
<p>基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>							

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 一、《东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方多策略灵活配置混合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

2021 年 7 月 21 日