

东方双债添利债券型证券投资基金

2023 年第 3 季度报告

2023 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：2023 年 10 月 25 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 2023 年 10 月 24 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 2023 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		
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	1,267,073,588.50 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和风险收益特征，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	东方双债添利债券 C	东方双债添利债券 D

下属分级基金的交易代码	400027	400029	019095
报告期末下属分级基金的份额总额	1,225,281,078.70 份	41,730,366.16 份	62,143.64 份

注：本基金从 2023 年 8 月 24 日起增加 D 基金份额，相关公告已于 2023 年 8 月 23 日在中国证监会基金电子披露网站、《证券日报》和本公司网站上进行披露。

§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（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）		报告期（2023 年 8 月 24 日-2023 年 9 月 30 日）
	东方双债添利债券 A	东方双债添利债券 C	东方双债添利债券 D
1. 本期已实现收益	-17,248,406.76	-501,040.53	-455.42
2. 本期利润	-43,846,752.59	-1,631,570.43	-1,949.73
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0337	-0.0300	-0.0404
4. 期末基金资产净值	1,459,097,854.51	49,395,345.92	74,015.22
5. 期末基金份额净值	1.1908	1.1837	1.1910

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

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	-2.71%	0.48%	-0.76%	0.17%	-1.95%	0.31%
过去六个月	-2.91%	0.49%	-1.03%	0.17%	-1.88%	0.32%
过去一年	-0.46%	0.47%	0.08%	0.19%	-0.54%	0.28%
过去三年	3.68%	0.49%	-0.05%	0.23%	3.73%	0.26%

过去五年	22.02%	0.45%	8.98%	0.24%	13.04%	0.21%
自基金合同 生效起至今	79.49%	0.60%	22.92%	0.29%	56.57%	0.31%

东方双债添利债券 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	-2.81%	0.48%	-0.76%	0.17%	-2.05%	0.31%
过去六个月	-3.10%	0.49%	-1.03%	0.17%	-2.07%	0.32%
过去一年	-0.91%	0.47%	0.08%	0.19%	-0.99%	0.28%
过去三年	2.39%	0.49%	-0.05%	0.23%	2.44%	0.26%
过去五年	19.66%	0.45%	8.98%	0.24%	10.68%	0.21%
自基金合同 生效起至今	73.35%	0.60%	22.92%	0.29%	50.43%	0.31%

东方双债添利债券 D

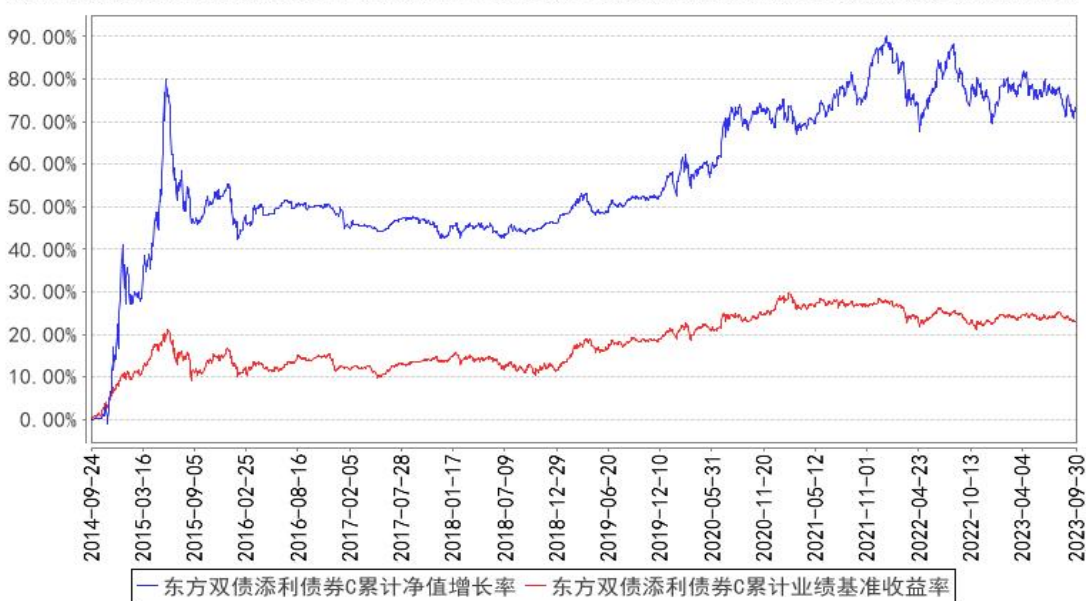
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
自基金合同 生效起至今	0.50%	0.57%	-0.58%	0.15%	1.08%	0.42%

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

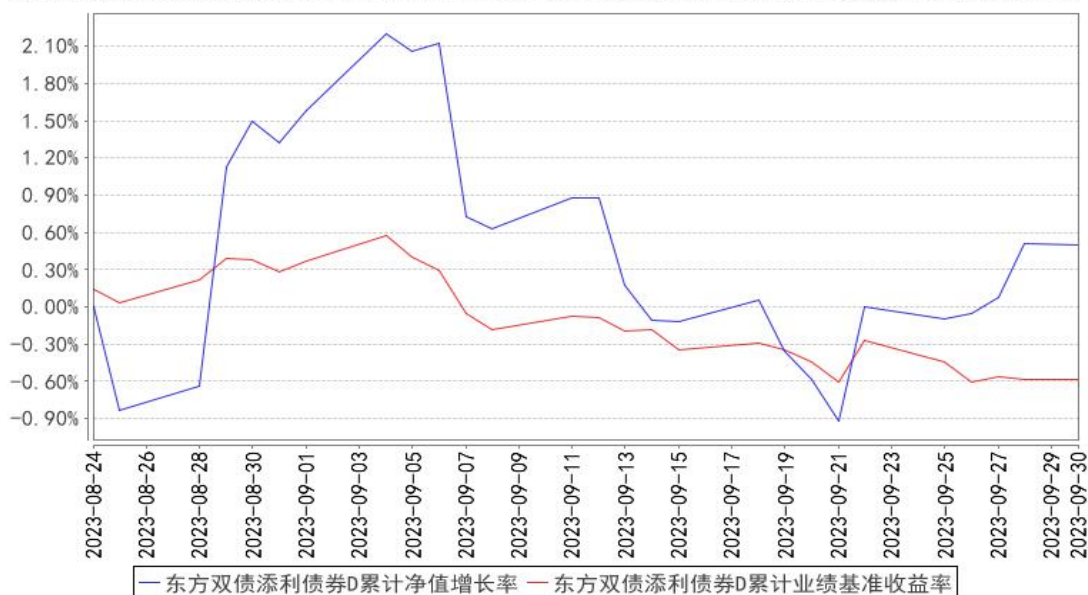
东方双债添利债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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D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	本基金基金经理、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	2019年11月14日	-	18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，18年证券从业经历。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、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，东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方兴润债券型证券投资基金基金经理，现任东方双债添利债券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。

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》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》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中的公平交易程序；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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，外围局势逐渐稳定但压力仍在。俄乌冲突继续胶着，中美关系有所缓和。美国经济持续强于预期，联储再次加息，对人民币汇率形成一定压制。国内经济 3 季度触底回升，但市场

对于经济企稳后的弹性和持续性仍然存在分歧，内生动能的持续性和长期问题的解决等尚未得到解决。较好的一面是政策方面暖风频吹，货币政策继续偏宽松，财政刺激虽不明显但也有加码迹象，开始逐步加大对各地城投“化债”的支持，基调上鼓励和支持民营企业发展，对外政策也出现合作倾向。整体而言，国内经济三季度弱势复苏，投资人对经济信心偏弱，风险偏好并未提升。受此影响，三季度股票市场有所回落，债市依然表现较好。

本基金操作方面，我们基本维持了 2 季度的投资策略，对股票和债券市场的预期做出了小幅调整，配置上更趋均衡，适度回补了周期仓位，降低了科技成长板块，同时增加了可转债配置比例。具体在股票操作方面，3 季度减持了人工智能板块，部分回补了化工银行等周期类股票，回补了医药、白酒仓位，维持了电子和先进制造如机器人等科技板块。整体表现尚可。可转债方面，我们再次减持了部分双低转债，增加了平衡型转债，提高了可转债组合的弹性和仓位。纯债方面，长端利率债清空，维持了一定短久期高资质信用债仓位。三季度业绩来看，基本达到预期。我们认为，四季度随着部分产业库存周期见底，消费等板块调整时间较长且年底面临估值切换，存在一定估值修复机会，各种政策刺激下，对四季度权益市场我们保持相对乐观的看法。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2023 年 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为-2.71%，业绩比较基准收益率为-0.76%，低于业绩比较基准 1.95%；本基金 C 类净值增长率为-2.81%，业绩比较基准收益率为-0.76%，低于业绩比较基准 2.05%；本基金 D 类净值增长率为 0.50%，业绩比较基准收益率为-0.58%，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	293,347,887.82	15.28
	其中：股票	293,347,887.82	15.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,618,256,794.66	84.28
	其中：债券	1,618,256,794.66	84.28
	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	6,829,391.64	0.36
8	其他资产	1,560,875.47	0.08
9	合计	1,919,994,949.59	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	27,265,400.00	1.81
C	制造业	193,723,558.26	12.84
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	4,646,400.00	0.31
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	39,845,929.56	2.64
J	金融业	3,081,800.00	0.20
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,974,500.00	1.32
M	科学研究和技术服务业	1,238,400.00	0.08
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	2,156,400.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	1,415,500.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	293,347,887.82	19.45

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

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	002027	分众传媒	2,350,000	16,802,500.00	1.11

2	600547	山东黄金	530,000	13,308,300.00	0.88
3	003021	兆威机电	171,000	12,556,530.00	0.83
4	600150	中国船舶	440,000	12,276,000.00	0.81
5	002747	埃斯顿	470,016	10,368,552.96	0.69
6	000683	远兴能源	1,300,000	9,191,000.00	0.61
7	600938	中国海油	410,000	8,667,400.00	0.57
8	300124	汇川技术	130,000	8,643,700.00	0.57
9	600941	中国移动	83,000	8,036,060.00	0.53
10	600570	恒生电子	220,000	7,139,000.00	0.47

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	78,881,748.29	5.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	85,306,318.09	5.65
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	117,459,540.16	7.79
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	144,387,689.61	9.57
7	可转债（可交换债）	1,192,221,498.51	79.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,618,256,794.66	107.27

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	110088	淮 22 转债	670,000	82,851,282.19	5.49
2	127056	中特转债	523,743	57,455,195.42	3.81
3	102002082	20 吴中国太 MTN002	500,000	51,824,194.52	3.44
4	111099	20SZMC08	500,000	51,320,339.73	3.40
5	185359	22 海通 02	500,000	50,865,534.25	3.37

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

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

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是否出现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、处罚的情形

本基金所持有远兴能源（000683），发行人内蒙古远兴能源股份有限公司（以下简称“公司”），受到处罚。2022年9月7日，公司因未及时披露公司重大事项，被深圳证券交易所予以监管关注。2023年8月30日，公司因未及时披露公司重大事项，被中国证券监督管理委员会出具警示函。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。

本基金所持有恒生电子（600570），发行人恒生电子股份有限公司（以下简称“公司”），受到处罚。2023年6月15日，公司高管因未依法履行职责，被中国证券监督管理委员会出具警示函。涉事高管已辞去公司副总裁职务，公司将加强培训工作，督促相关人员严格规范买卖公司股票的行为，审慎操作，防止此类事件再次发生。

本基金所持有 21 国君 12（188736），发行人国泰君安证券股份有限公司（以下简称“公司”），受到处罚。公司因未依法履行职责，被中国人民银行公开处罚。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。

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。

本基金投资远兴能源（000683）主要基于以下原因：

公司是国内纯碱龙头企业，随着新产能投放完毕，公司将成为国内产能领先，拥有巨大的规模优势，同时技术方面天然碱法符合国家政策要求，同时具备低成本优势，相比同业而言具备较大成本优势。

本基金所持恒生电子（600570）基于以下原因：

公司的新产品 045 已经在部分金融机构成功上线，其功能较上一代产品更加丰富，该产品有望进一步加强公司护城河，公司依旧是国内金融系统领域龙头，地位稳固。

本基金所持 21 国君 12（188736）基于以下原因：

公司作为国内头部券商之一，股东背景强，主营业务位于行业头部，业务布局广泛，综合实力强劲，信用风险可控，具备投资价值。

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是否超出基金合同规定的备选股票库

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	181,906.22
2	应收证券清算款	1,378,939.26
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	29.99
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,560,875.47

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	110088	淮 22 转债	82,851,282.19	5.49
2	127056	中特转债	57,455,195.42	3.81
3	110061	川投转债	40,765,841.64	2.70
4	110082	宏发转债	36,627,284.51	2.43
5	123101	拓斯转债	29,656,385.95	1.97
6	113619	世运转债	24,550,387.85	1.63
7	113623	凤 21 转债	23,557,150.68	1.56
8	113633	科沃转债	23,342,638.47	1.55
9	113050	南银转债	23,198,002.52	1.54
10	113045	环旭转债	23,015,575.48	1.53
11	127041	弘亚转债	21,794,393.84	1.44
12	113638	台 21 转债	21,766,868.49	1.44
13	113060	浙 22 转债	20,388,946.55	1.35
14	123122	富瀚转债	19,354,290.34	1.28
15	127051	博杰转债	19,259,306.54	1.28
16	110062	烽火转债	19,148,105.48	1.27
17	123142	申昊转债	18,794,945.30	1.25
18	113542	好客转债	18,662,127.39	1.24
19	128123	国光转债	18,319,986.62	1.21
20	118018	瑞科转债	18,159,579.18	1.20
21	118014	高测转债	17,744,484.25	1.18
22	128131	崇达转 2	17,727,488.31	1.18
23	128125	华阳转债	17,717,397.70	1.17

24	127050	麒麟转债	17,635,342.39	1.17
25	113602	景 20 转债	17,333,419.53	1.15
26	123124	晶瑞转 2	17,181,170.99	1.14
27	127066	科利转债	16,980,045.03	1.13
28	113061	拓普转债	15,745,991.97	1.04
29	128121	宏川转债	15,697,183.56	1.04
30	110079	杭银转债	15,121,022.16	1.00
31	123107	温氏转债	14,901,320.55	0.99
32	127012	招路转债	13,789,829.45	0.91
33	123088	威唐转债	13,321,301.37	0.88
34	127052	西子转债	12,530,150.38	0.83
35	113639	华正转债	12,355,917.81	0.82
36	123157	科蓝转债	12,318,750.71	0.82
37	128133	奇正转债	12,282,106.57	0.81
38	113608	威派转债	11,913,224.84	0.79
39	113632	鹤 21 转债	11,721,906.85	0.78
40	113043	财通转债	11,279,794.52	0.75
41	123065	宝莱转债	11,153,340.45	0.74
42	127031	洋丰转债	10,453,860.12	0.69
43	111008	沿浦转债	10,007,069.78	0.66
44	123113	仙乐转债	9,812,521.73	0.65
45	123104	卫宁转债	9,779,590.14	0.65
46	118004	博瑞转债	9,005,099.18	0.60
47	113636	甬金转债	8,058,680.00	0.53
48	123163	金沃转债	8,005,519.73	0.53
49	113618	美诺转债	7,960,300.51	0.53
50	123059	银信转债	7,208,477.24	0.48
51	123109	昌红转债	7,083,626.63	0.47
52	123108	乐普转 2	6,980,796.30	0.46
53	123064	万孚转债	6,878,640.10	0.46
54	113593	沪工转债	6,830,400.00	0.45
55	123099	普利转债	6,409,961.77	0.42
56	123103	震安转债	6,349,965.48	0.42
57	113524	奇精转债	6,066,146.63	0.40
58	128039	三力转债	5,890,709.59	0.39
59	123087	明电转债	5,692,599.53	0.38
60	110089	兴发转债	5,589,993.15	0.37
61	118015	芯海转债	5,516,023.29	0.37
62	113030	东风转债	5,495,796.44	0.36
63	113588	润达转债	5,168,474.25	0.34
64	111003	聚合转债	5,048,128.44	0.33
65	118027	宏图转债	4,983,966.03	0.33

66	123131	奥飞转债	4,798,007.01	0.32
67	118006	阿拉转债	4,557,807.12	0.30
68	123145	药石转债	4,365,259.32	0.29
69	128136	立讯转债	4,114,893.14	0.27
70	127046	百润转债	3,933,155.27	0.26
71	118009	华锐转债	3,918,369.20	0.26
72	111002	特纸转债	3,798,164.38	0.25
73	127072	博实转债	3,485,746.58	0.23
74	118017	深科转债	3,478,657.81	0.23
75	113591	胜达转债	3,414,124.11	0.23
76	113565	宏辉转债	3,252,242.47	0.22
77	123158	宙邦转债	3,217,576.13	0.21
78	113574	华体转债	3,215,125.70	0.21
79	123151	康医转债	3,170,199.95	0.21
80	123119	康泰转 2	2,949,383.01	0.20
81	113573	纵横转债	2,858,612.38	0.19
82	113546	迪贝转债	2,833,222.69	0.19
83	127079	华亚转债	2,810,654.41	0.19
84	113579	健友转债	2,739,422.58	0.18
85	127065	瑞鹄转债	2,694,033.86	0.18
86	128072	翔鹭转债	2,633,594.52	0.17
87	123175	百畅转债	2,614,264.59	0.17
88	123133	佩蒂转债	2,461,393.60	0.16
89	128137	洁美转债	2,362,418.63	0.16
90	127062	垒知转债	2,310,087.12	0.15
91	113628	晨丰转债	2,279,078.63	0.15
92	113650	博 22 转债	2,153,416.44	0.14
93	113658	密卫转债	2,000,815.89	0.13
94	123126	瑞丰转债	1,964,774.86	0.13
95	118003	华兴转债	1,960,793.76	0.13
96	113063	赛轮转债	1,956,876.47	0.13
97	123169	正海转债	1,940,141.79	0.13
98	113663	新化转债	1,931,727.95	0.13
99	127054	双箭转债	1,909,413.70	0.13
100	113594	淳中转债	1,906,560.82	0.13
101	113624	正川转债	1,824,762.88	0.12
102	113643	风语转债	1,821,723.29	0.12
103	113657	再 22 转债	1,723,932.89	0.11
104	113598	法兰转债	1,719,286.03	0.11
105	113561	正裕转债	1,669,602.82	0.11
106	123115	捷捷转债	1,668,030.82	0.11
107	123039	开润转债	1,635,209.97	0.11

108	127022	恒逸转债	1,594,704.05	0.11
109	123180	浙矿转债	1,493,053.92	0.10
110	123170	南电转债	1,295,344.93	0.09
111	113062	常银转债	1,232,361.17	0.08
112	127032	苏行转债	1,212,269.86	0.08
113	113662	豪能转债	1,200,138.36	0.08
114	110067	华安转债	1,159,459.45	0.08
115	113519	长久转债	1,103,392.22	0.07
116	127071	天箭转债	1,085,006.71	0.07
117	127076	中宠转 2	843,426.36	0.06
118	111009	盛泰转债	712,642.49	0.05
119	123132	回盛转债	691,416.16	0.05
120	128049	华源转债	665,450.68	0.04
121	118016	京源转债	617,105.46	0.04
122	123085	万顺转 2	505,217.53	0.03
123	127043	川恒转债	489,038.36	0.03
124	123127	耐普转债	469,711.98	0.03
125	111004	明新转债	401,739.86	0.03
126	123162	东杰转债	375,317.26	0.02
127	123061	航新转债	374,430.33	0.02
128	123160	泰福转债	328,402.86	0.02
129	118032	建龙转债	232,225.25	0.02
130	128097	奥佳转债	231,113.42	0.02
131	113616	韦尔转债	226,068.55	0.01
132	127053	豪美转债	126,198.77	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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方双债添利债券 A	东方双债添利债券 C	东方双债添利债券 D
报告期期初基金份额总额	1,334,264,346.14	99,757,453.75	-
报告期期间基金总申购份额	73,663,177.98	41,869.39	104,540.30
减:报告期期间基金总赎回份额	182,646,445.42	58,068,956.98	42,396.66
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	1,225,281,078.70	41,730,366.16	62,143.64

§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

2023 年 10 月 25 日