

东方成长收益平衡混合型证券投资基金 2017年第2季度报告

2017年6月30日

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年七月十九日

§ 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 7 月 17 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。

本基金由东方保本混合型开放式证券投资基金（以下简称“东方保本”）转型而来，东方保本的保本周期为三年，于 2014 年 5 月 5 日起进入第二个保本周期，并于 2017 年 5 月 5 日到期。因未能符合保本基金存续条件，东方保本按照基金合同的约定转型为非保本的混合型基金，即“东方成长收益平衡混合型证券投资基金”。基金托管人及基金登记机构保持不变，基金代码沿用东方保本的基金代码“400013”。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、业绩比较基准、估值方法、基金费率等相关内容按照《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》的相关约定进行运作。上述转型事项已按照法律法规的规定及基金合同的约定履行相应程序，详见 2017 年 4 月 20 日、2017 年 4 月 21 日及 2017 年 4 月 27 日在公司官网发布的相关公告。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。其中，自 2017 年 5 月 5 日（含）起至 2017 年 5 月 10 日（含）止为东方保本混合型开放式证券投资基金保本周期到期期间，并自 2017 年 5 月 11 日起，东方保本混合型开放式证券投资基金正式转型为东方成长收益平衡混合型证券投资基金。本报告按基金转型前后的两个报告期进行编制。其中，基金转型前的报告期间为 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 5 月 10 日止，基金转型后的报告期为 2017 年 5 月 11 日起至 2017 年 6 月 30 日。

§ 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	东方成长收益平衡
基金主代码	400013

交易代码	400013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 5 月 11 日
报告期末基金份额总额	228, 197, 637. 53 份
投资目标	力争在股票、债券、现金等大类资产的适度平衡配置下, 有效控制投资组合的风险, 追求长期资本增值和稳定收益。
投资策略	本基金将充分发挥基金管理人的研究优势, 将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合, 在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上, 动态调整投资组合比例, 自上而下灵活配置资产; 通过把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化, 挖掘预期具有良好增长前景的优势行业; 结合定量筛选与定性分析, 精选个股, 以谋求超额收益。
业绩比较基准	沪深 300 相对成长指数收益率×55%+中证全债指数收益率×45%。
风险收益特征	本基金属于混合型基金, 为证券投资基金中的风险适中品种。长期平均的风险和预期收益低于股票型基金, 高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

转型前:

基金简称	东方保本混合
基金主代码	400013
交易代码	400013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 4 月 14 日
报告期末基金份额总额	230, 532, 403. 63 份
投资目标	本基金通过保本资产与收益资产的动态配置和有效的组合管理, 在保本周期到期时, 为保本周期内认购并持有到期的基金份额提供保本金额安全保证的基础上, 力求基金资产的稳定增值。
投资策略	在大类资产配置方面, 本基金运用 CPPI 固定比例投资组合保险机制, 来动态分配基金资产在收益资产和保本资产上的投资比例。 在保本资产投资方面, 以追求本金安全为目的。即通过持有相当数量的剩余期限小于或等于保本周期的债券等低风险固定收益类证券, 并规避利率、再投资等风险, 以确保保本资产的稳定收益。 在收益资产投资方面, 以追求收益为目的。即采用积极投资方式, 把握市场时机、挖掘市场热点, 精选个股, 获取稳定的资本增值。

业绩比较基准	本基金以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准。
风险收益特征	本基金是保本混合型的基金产品,属于证券投资基金中的低风险品种。
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2017 年 5 月 11 日 — 2017 年 6 月 30 日 ）
1. 本期已实现收益	2,446,882.30
2. 本期利润	3,028,214.36
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0132
4. 期末基金资产净值	268,997,022.45
5. 期末基金份额净值	1.179

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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2017 年 4 月 1 日 — 2017 年 5 月 10 日 ）
1. 本期已实现收益	-102,456.64
2. 本期利润	733,187.22
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0024
4. 期末基金资产净值	268,702,467.04
5. 期末基金份额净值	1.1660

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。

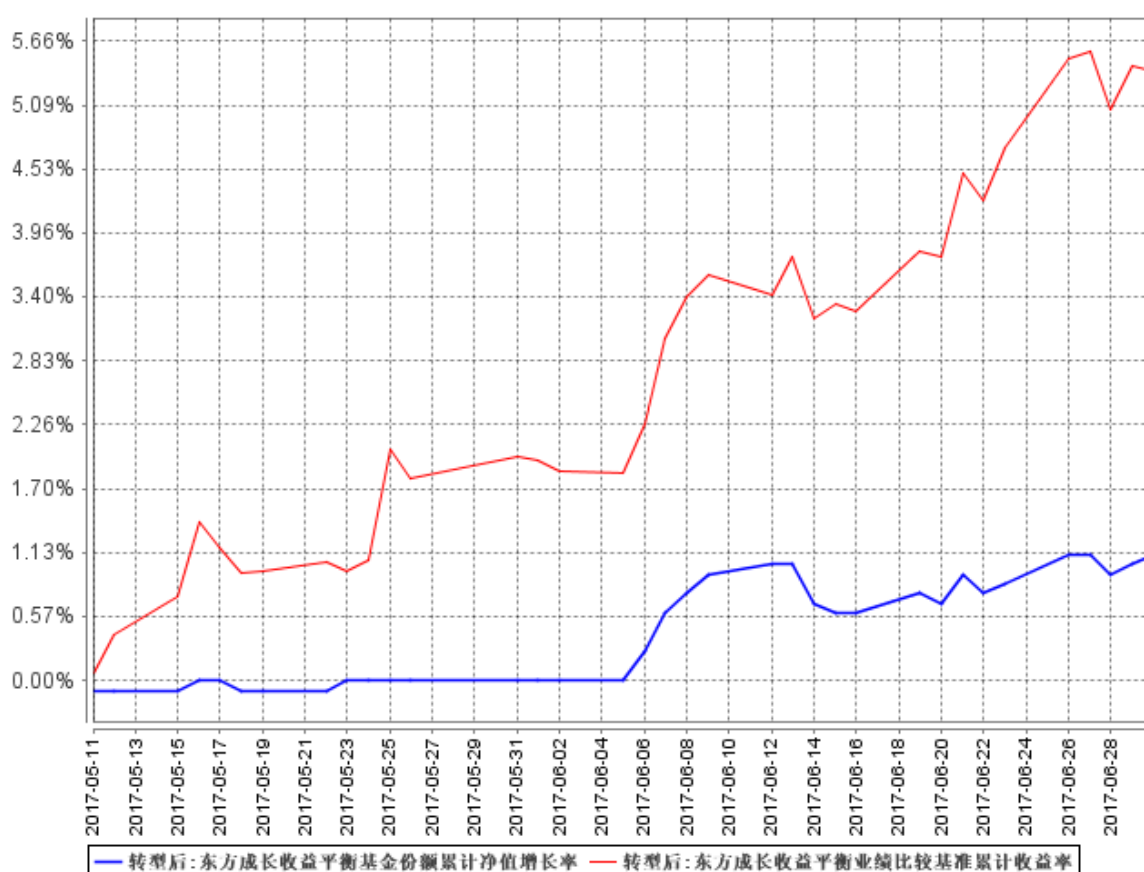
3.2 基金净值表现（转型后）

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	①-③	②-④
过去三个月 (2017.5.11-2017.6.30)	1.11%	0.13%	5.39%	0.36%	-4.28%	-0.23%

3.2.2 自基金转型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

东方成长收益平衡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



注：本基金于 2017 年 5 月 11 日转型，截至报告期末，转型后基金合同生效不满六个月，仍处于建仓期。

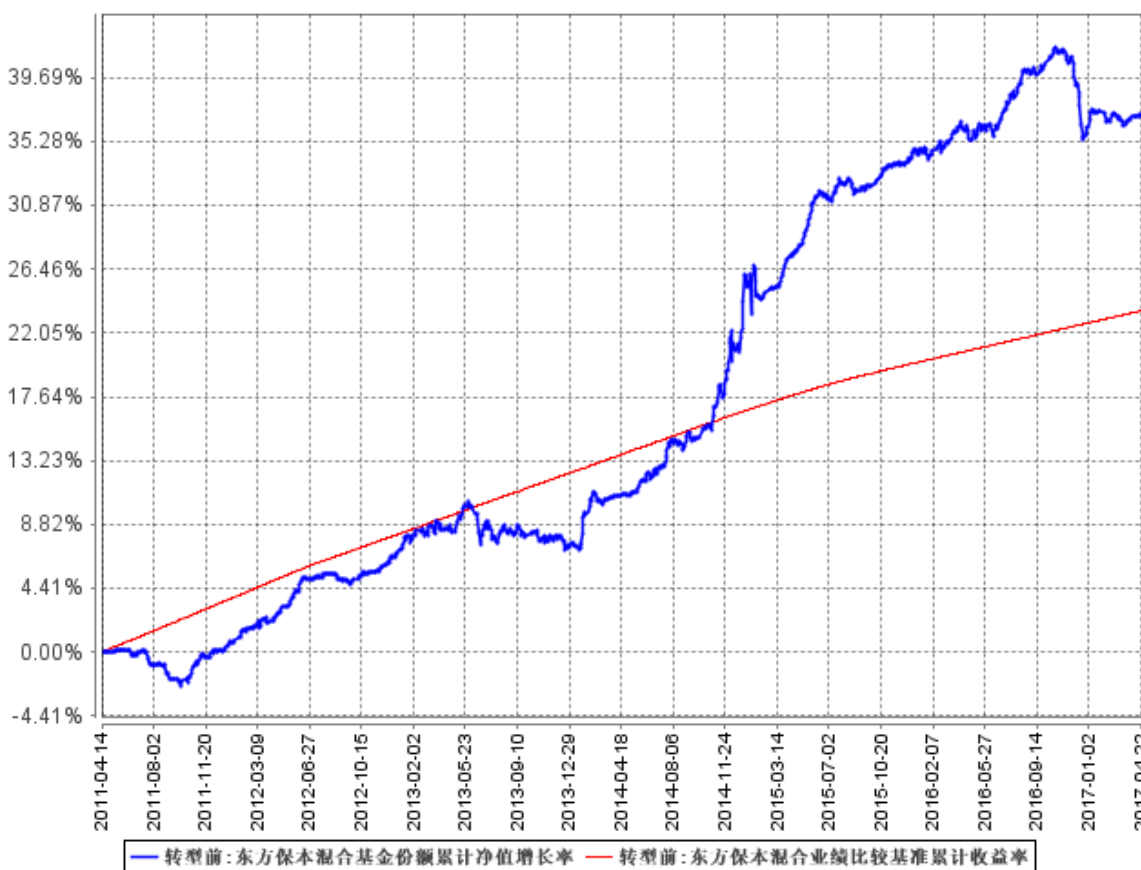
3.2 基金净值表现（转型前）

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	①—③	②—④
过去三个月 (2017.4.1-2017.5.10)	0.26%	0.04%	0.24%	0.01%	0.02%	0.03%

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

东方保本混合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（转型前）

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		
姚航	本基金基金经理、固定收益部副总经理、投资决策委员会委员	2013 年 9 月 25 日	-	13 年	中国人民大学工商管理硕士，13 年证券从业经历。曾就职于嘉实基金管理有限公司运营部。2010 年 10 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任债券交易员、东方金账簿货币市场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、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金（于 2017 年 5 月 11 日起转型为东方成长收益平衡混合型证券投资基金）基金经理，现任固定收益部副总经理、投资决策委员会委员、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金经理、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方金元宝货币市场基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理、东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型

					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。
王然	本基金基金经理	2015 年 4 月 30 日	-	9 年	北京交通大学产业经济学硕士，9 年证券从业经历，曾任益民基金交通运输、纺织服装、轻工制造行业研究员。2010 年 4 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究员，东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于 2015 年 8 月 7 日更名为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理助理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于 2015 年 8 月 7 日更名为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金（于 2017 年 5 月 11 日转型为东方成长收益平衡混合型基金）基金经理，现任东方成长收益平衡混合型基金基金经理、东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方荣家保本混

					<p>合型证券投资基金基金经理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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		
姚航	本基金基金经理、固定收益部副总经理、投资决策委员会委员	2013 年 9 月 25 日	-	13 年	<p>中国人民大学工商管理硕士，13 年证券从业经历。曾就职于嘉实基金管理有限公司运营部。2010 年 10 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任债券交易员、东方金账簿货币市场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、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金（于 2017 年 5 月 11 日起转型为东方成长收益平衡混合型基金）基金经理，现任固定收益部副总经理、投资决策委员会委员、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方成长收益平</p>

					<p>衡混合型基金经理、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方金元宝货币市场基金经理、东方金证通货币市场基金经理、东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合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。</p>
王然	本基金经理	2015 年 4 月 30 日	-	9 年	<p>北京交通大学产业经济学硕士，9 年证券从业经历，曾任益民基金交通运输、纺织服装、轻工制造行业研究员。2010 年 4 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究员，东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于 2015 年 8 月 7 日更名为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理助理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于 2015 年 8 月 7 日更名为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金</p>

					<p>(于 2017 年 5 月 11 日转型为东方成长收益平衡混合型基金) 基金经理, 现任东方成长收益平衡混合型基金基金经理、东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》、《东方保本混合型开放式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

从基本面来看，2017 年二季度经济表现平稳、韧性较强，需求好于预期。具体而言，工业企业利润增长强劲，PPI 缓慢回落对收入端仍有支撑；PMI 仍处高位，显示内外需均表现较好；主要港口吞吐量也显示贸易或仍处于较高景气区间。

从政策来看，2017 年二季度金融监管机构密集发布文件，去杠杆思路明确，银监会的“三套利、三违反、四不当”引发市场担忧，6 月以来严监管略有缓和，银行业务自查报告可延期 3 个月提交，或体现监管层加强协同，以避免极端冲击，从而实现温和去杠杆的目标。

从债券市场来看，2017 年二季度债券收益率先上后下，较一季度末仍有所上行，市场关注的焦点主要聚焦于金融监管政策及流动性。具体而言，4 月至 5 月中上旬，在监管政策密切出台、

基本面表现较好等因素影响下，现券收益率上行；6 月以来收益率快速下行主要源于市场预期修复，以及货币政策维稳、严监管政策趋缓。

报告期内，本基金组合较为稳定，以享受票息为主，获得了较好的绝对收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2017 年 4 月 1 日起至 2017 年 5 月 10 日，转型前基金（东方保本混合型开放式证券投资基金）净值增长率为 0.26%，业绩比较基准增长率为 0.30%，低于业绩比较基准 0.04%。2017 年 5 月 11 日起至 2017 年 6 月 30 日，转型后基金（东方成长收益平衡混合型证券投资基金）净值增长率为 1.11%，业绩比较基准增长率为 5.39%，低于业绩比较基准 4.28%。

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

转型后：

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	34,274,608.20	11.19
	其中：股票	34,274,608.20	11.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	166,314,495.80	54.28
	其中：债券	166,314,495.80	54.28
	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	100,000,510.00	32.63
	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	4,354,568.38	1.42
8	其他资产	1,480,353.91	0.48
9	合计	306,424,536.29	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	8,231,900.00	3.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,592,500.00	2.08
E	建筑业	3,934,000.00	1.46
F	批发和零售业	1,130,500.00	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	9,885,108.20	3.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	3,150,000.00	1.17
K	房地产业	2,350,600.00	0.87
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	34,274,608.20	12.74

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	600068	葛洲坝	350,000	3,934,000.00	1.46
2	600056	中国医药	140,000	3,633,000.00	1.35
3	600377	宁沪高速	349,909	3,429,108.20	1.27
4	601006	大秦铁路	400,000	3,356,000.00	1.25
5	600886	国投电力	400,000	3,160,000.00	1.17
6	601398	工商银行	600,000	3,150,000.00	1.17
7	600350	山东高速	500,000	3,100,000.00	1.15
8	603355	莱克电气	50,000	2,938,500.00	1.09
9	600995	文山电力	250,000	2,432,500.00	0.90
10	600340	华夏幸福	70,000	2,350,600.00	0.87

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	9,992,000.00	3.71
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	37,411,495.80	13.91
5	企业短期融资券	19,996,000.00	7.43
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	98,915,000.00	36.77
9	其他	-	-
10	合计	166,314,495.80	61.83

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	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111720130	17 广发银行 CD130	500,000	49,465,000.00	18.39
2	111707141	17 招商银行 CD141	500,000	49,450,000.00	18.38
3	041761010	17 吉安井开 CP001	200,000	19,996,000.00	7.43
4	122679	PR 河套债	224,380	16,920,495.80	6.29
5	124972	14 安高债	100,000	10,473,000.00	3.89

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在本报告期内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、处罚的情形。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	137,218.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,342,413.74
5	应收申购款	721.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,480,353.91

5.11.4 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。

5.11.5 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。

转型前：

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	-	-
	其中：债券	-	-

	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	271,974,055.49	101.22
8	其他资产	176,500.55	0.07
9	合计	272,150,556.04	101.28

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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在本报告期内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、处罚的情形。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	125,902.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	50,597.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	176,500.55

5.11.4 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。

5.11.5 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（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2017年5月11日）基金份 额总额	230,257,821.76
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份 额	369,267.94
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回 份额	2,429,452.17
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动 份额（份额减少以“-”填列）	-

报告期期末基金份额总额	228,197,637.53
-------------	----------------

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	319,759,867.57
报告期期间基金总申购份额	307,818.73
减：报告期期间基金总赎回份额	89,535,282.67
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	230,532,403.63

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	8,888,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	8,888,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	3.89

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型后）

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	8,888,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	8,888,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	3.86

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

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	2017-4-1 至 2017-6-30	172,264,427.21	-	-	172,264,427.21	75.49%
个人	-	-	-	-	-	-	-
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

10.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予东方保本混合型证券投资基金募集的文件
- (2) 《东方成长收益平衡混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《东方成长收益平衡混合型证券投资基金招募说明书》
- (4) 《东方成长收益平衡混合型证券投资基金托管协议》
- (5) 《东方保本混合型开放式证券投资基金基金合同》
- (6) 《东方保本混合型开放式证券投资基金招募说明书》
- (7) 《东方保本混合型开放式证券投资基金托管协议》
- (8) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (9) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (10) 中国证监会要求的其他文件

10.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

10.3 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。

东方基金管理有限责任公司
2017 年 7 月 19 日