

# 东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金

## 2018 年第 3 季度报告

2018 年 9 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：二〇一八年十月二十五日

## § 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 2018 年 10 月 23 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	东方成长收益灵活配置
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	2018 年 1 月 17 日
报告期末基金份额总额	58,878,239.08 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

### § 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7月1日－2018年9月30日）
1. 本期已实现收益	-2,438,054.15
2. 本期利润	-1,972,458.68
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0322
4. 期末基金资产净值	68,139,821.69
5. 期末基金份额净值	1.157

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。

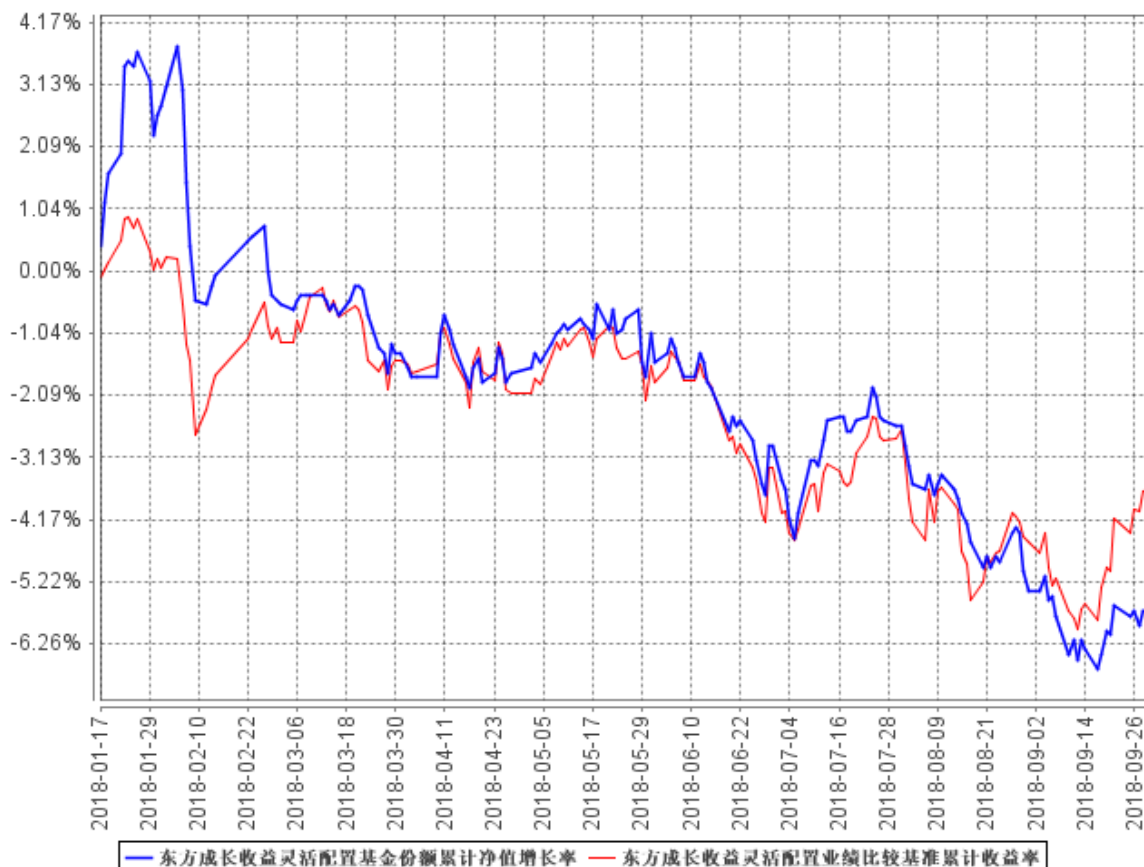
#### 3.2 基金净值表现

##### 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

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	-2.85%	0.32%	-0.38%	0.40%	-2.47%	-0.08%

### 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

东方成长收益灵活配置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：本基金基金合同于 2018 年 1 月 17 日生效，建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

## § 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		
王然（女士）	本基金基金经理、	2018 年 1 月 17 日	2018 年 8 月 17 日	10 年	研究部副总经理，投资决策委员会委员，

	<p>研究部副 总经理、 投资决策 委员会委 员</p>			<p>北京交通大学产业经 济学硕士，10 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 日转型 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 转型为东方策略成长 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、东方荣家 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（于 2017 年 9 月 13 日起转型为东方民丰 回报赢安混合型证券 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 （于 2018 年 1 月 17 日转型为东方成长收 益灵活配置混合型证 券投资基金）基金经</p>
--	--	--	--	--

					理、东方成长收益灵活配置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、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理，现任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、东方民丰回报赢安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、东方大健康混合型证券投资基金基金经理。
姚航（女士）	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	2018 年 1 月 17 日	-	14 年	固定收益部副总经理，投资决策委员会委员，中国人民大学工商管理硕士，14 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）

					<p>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（于 2017 年 9 月 13 日起转型为东方民丰回报赢安混合型证券投资基金）基金经理、东方成长收益平衡混合型证券投资基金（于 2018 年 1 月 17 日转型为东方成长收益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、东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方成长收益灵活配置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、东方民丰回报赢安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>
郭瑞（先生）	本基金基金经理	2018 年 1 月 17 日	-	7 年	<p>中国科学院研究生院概率论与数理统计硕士，7 年证券从业经历，曾任中国移动通信集团公司项目经理、宏源证券股份有限公司北京资产管理分公司高级研究员、润晖投资咨询（北京）有限公司高级研究</p>

				<p>员。2015 年 8 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任权益投资部研究员、东方创新科技混合型证券投资基金基金经理助理、东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理、东方成长收益平衡混合型证券投资基金（于 2018 年 1 月 17 日转型为东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金），现任东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方创新科技混合型证券投资基金基金经理、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理、东方人工智能主题混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	---

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《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

2018 年三季度，权益方面，上证指数下跌 0.92%，深圳成指下跌 10.43%，创业板指数下跌 11.22%，沪深 300 指数下跌 2.05%。行业和个股分化较为严重，银行、非银、钢铁、煤炭等行业在三季度表现较好。家电、医药、电子等行业明显下跌。

基于对市场的判断，我们主动降低了仓位，截止季度末，整体仓位在 61% 左右水平。三季度主要增持了平安银行、海能达、中国联通等个股，减持了云南白药、海螺水泥、海大集团等个股。

从基本面和估值上看，A 股短期进一步大幅下跌的空间不大，但受制于中美贸易战带来的中

短期不确定性，市场在这个点位上震荡筑底的概率较大，我认为市场整体向上向下的空间都不太大。

从操作策略上，将保持“精选个股、长期持有”，我们将继续精选个股，选择市场竞争格局好，行业发展较快，竞争力强，业绩增长较快，估值合理、盈利能力较强，资产质量较好，盈利质量较高的个股进行投资。

2018 年三季度，基本面下行走势确认、中美贸易摩擦升级，在此背景下，政策组合向“宽货币、宽信用”的方向转变。受制于金融机构风险偏好、银行资本金、资管新规大方向未变等实际限制，宽货币向宽信用的传导仍不尽顺畅。

债券方面，债券收益率先下后上，由二季度的趋势下行转为震荡行情，10 年国债、国开债收益率分别较二季度末上行 14BP、下行 5BP。具体来看，宽货币政策背景下，短端利率下行明显；宽信用政策陆续出台，市场对基本面的悲观情绪有所修正，食品价格反弹带动通胀预期回升，此外地方债发行放量，挤出机构对其余券种的配置力量，长端利率震荡盘整；信用市场方面，宽信用政策带动信用净融资额反弹，城投债市场情绪改善，但低评级及民企信用债融资额未见明显反弹，信用市场仍分化明显。

报告期内，本基金组合较为稳定，以享受票息为主，债券部分获得了较好的绝对收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2018 年 7 月 1 日起至 2018 年 9 月 30 日，本基金净值增长率为-2.85%，业绩比较基准收益率为-0.38%，低于业绩比较基准 2.47%。

#### 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	15,627,508.48	22.41

	其中：股票	15,627,508.48	22.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	22,590,100.00	32.39
	其中：债券	22,590,100.00	32.39
	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	26,000,159.00	37.28
	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	5,092,425.36	7.30
8	其他资产	427,332.83	0.61
9	合计	69,737,525.67	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	-	-
C	制造业	9,048,338.48	13.28
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	5,474,170.00	8.03
J	金融业	1,105,000.00	1.62
K	房地产业	-	-
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	15,627,508.48	22.93

### 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	000651	格力电器	80,000	3,216,000.00	4.72
2	600050	中国联通	500,000	2,785,000.00	4.09
3	002583	海能达	249,908	2,014,258.48	2.96
4	002396	星网锐捷	100,000	1,774,000.00	2.60
5	000001	平安银行	100,000	1,105,000.00	1.62
6	300017	网宿科技	110,000	1,021,900.00	1.50
7	002065	东华软件	100,000	900,000.00	1.32
8	002465	海格通信	100,000	880,000.00	1.29
9	600760	中航沈飞	10,000	381,000.00	0.56
10	002230	科大讯飞	11,000	314,270.00	0.46

### 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	2,942,100.00	4.32
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,000,000.00	14.68
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	9,648,000.00	14.16
9	其他	-	-
10	合计	22,590,100.00	33.15

### 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	111809225	18 浦发银行 CD225	100,000	9,648,000.00	14.16
2	101800440	18 太湖新城 MTN003	50,000	5,012,500.00	7.36
3	101800429	18 京国资 MTN001	50,000	4,987,500.00	7.32
4	112298	15 新证债	30,000	2,942,100.00	4.32
5	-	-	-	-	-

## 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

本基金所持有格力电器（000651.SZ）于 2017 年 7 月 26 日对外公告了收到行政监管措施决定书的事宜。珠海格力电器股份有限公司董事会于 2017 年 7 月 26 日发布公告，公告称，珠海格力电器股份有限公司近日收到中国证券监督管理委员会广东监管局对公司董事徐自发先生下达的行政监管措施决定书《关于对徐自发采取出具警示函措施的决定》（（2017）39 号），徐自发先生于 2017 年 5 月 22 日通过深圳证券交易所集中竞价交易系统减持了本公司部分股份。减持过程中，因其委托某券商营业部客户经理对短线交易相关法律法规理解偏差，出现本次短线交易。公司已于 2017 年 5 月 27 日对相关情况进行了公告（公告编号：2017-020），徐自发先生因本次短线交易产生的收益 2,829,824.5 元已经收归公司所有。

本基金所持有平安银行（000001.SZ）于 2018 年 8 月 1 日因违反《中华人民共和国反洗钱法》被行政处罚。根据中国人民银行公布的银反洗罚决字【2018】1 号-5 号，2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日，平安银行未按照规定履行客户身份识别义务，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（一）项规定，处以 50 万元罚款；未按照规定保存客户身份资料和交易记录，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（二）项规定，处以 40 万元罚款；未按照规定报送大额交

易报告或者可疑交易报告，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（三）项规定，处以 50 万元罚款；对平安银行合计处以 140 万元罚款，并根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（一）项、第（二）项和第（三）项规定，对相关责任人共处以 14 万元罚款。

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。

本基金投资格力电器主要基于以下原因：

珠海格力电器股份有限公司，1989 年 12 月 13 日成立，是全球最大的集研发、生产、销售、服务

于一体的专业化空调企业。公司是中国空调行业唯一的“世界名牌”产品供应商，亦是全球最大的空调供应商（家用产能超 6000 万台+商用空调 550 万台，国内市占率 43%左右，1995 年至今空调产销量连续 18 年位居中国第一，2005 年至今连续 8 年位居世界第一，利税规模连续 11 年居中国电行业榜首暗示：具有社会效益），其产品（自主品牌+ODM）远销全球 200 多个国家和地区，但主战场仍集中在国内（内销收入比重在 80%~90%）。

格力目前处于行业龙头，现金流充裕，上下游资金占用能力很强，具有较高的 ROE 水平；同时不断加大研发、积极推进企业转型，大力变革渠道。当前格力具有战略清晰+战略执行力强+治理清晰+具备较好的企业文化，以及管理层规划五年再造一个格力的目标（以 2012 年收入 1000 亿元为基期，未来五年收入复合增速为 15%），预计公司中长期成长性较强。

本基金投资平安银行主要基于以下原因：

公司是深圳发展银行股份有限公司以吸收合并原平安银行股份有限公司的方式完成两行整合并更名后的银行，是全国性股份制商业银行。公司自 2016 年开始全面向零售银行转型，全力打造智能化零售银行，大力推进精品公司银行双轻化。综合金融是公司的特色优势，公司依托庞大的个人客户基础、强大的品牌影响力、广泛的分销网络和完备的综合金融产品体系，为全面推进零售转型、打造领先的智能化零售银行提供了强大的核心竞争力支持。在对公业务领域，公司利用大数据技术打造领先的中小企业数据征信平台，利用先进的 IT 系统打造橙 e 网、行 E 通、黄金银行等传统业务的新优势，提升对公司客户的数字化服务能力。

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。

### 5.11.2

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	35,830.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	349,088.74
5	应收申购款	42,413.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	427,332.83

#### 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。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	67,433,175.08
报告期期间基金总申购份额	321,046.37
减：报告期期间基金总赎回份额	8,875,982.37
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	58,878,239.08

### § 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	20180701 - 20180930	30,682,668.83	-	7,700,000.00	22,982,668.83	39.03%
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

### 9.1 备查文件目录

- 一、《东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方成长收益灵活配置混合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

2018 年 10 月 25 日