

东方可转债债券型证券投资基金

2021 年第 3 季度报告

2021 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年十月二十六日

§ 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东方可转债债券	
基金主代码	009465	
交易代码	009465	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 3 月 4 日	
报告期末基金份额总额	61,887,419.30 份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过对可转债的积极投资，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金的主要投资策略包括：大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略（1. 可转债债券和可交换债券投资策略；2. 普通债券投资策略；3. 资产支持证券投资策略）、权益类资产投资策略、国债期货的投资策略等。	
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%	
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	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东方可转债债券 A	东方可转债债券 C
下属分级基金的交易代码	009465	009466
报告期末下属分级基金的份额总额	37,888,274.40 份	23,999,144.90 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7月1日—2021年9月30日）	
	东方可转债债券 A	东方可转债债券 C
1. 本期已实现收益	733,515.82	137,833.70
2. 本期利润	962,941.83	-631,791.55
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0234	-0.0605
4. 期末基金资产净值	39,275,159.11	24,821,244.78
5. 期末基金份额净值	1.0366	1.0343

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

东方可转债债券 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	2.15%	0.83%	4.72%	0.47%	-2.57%	0.36%
过去六个月	3.57%	0.63%	8.12%	0.38%	-4.55%	0.25%
自基金合同生效起至今	3.66%	0.59%	7.45%	0.38%	-3.79%	0.21%

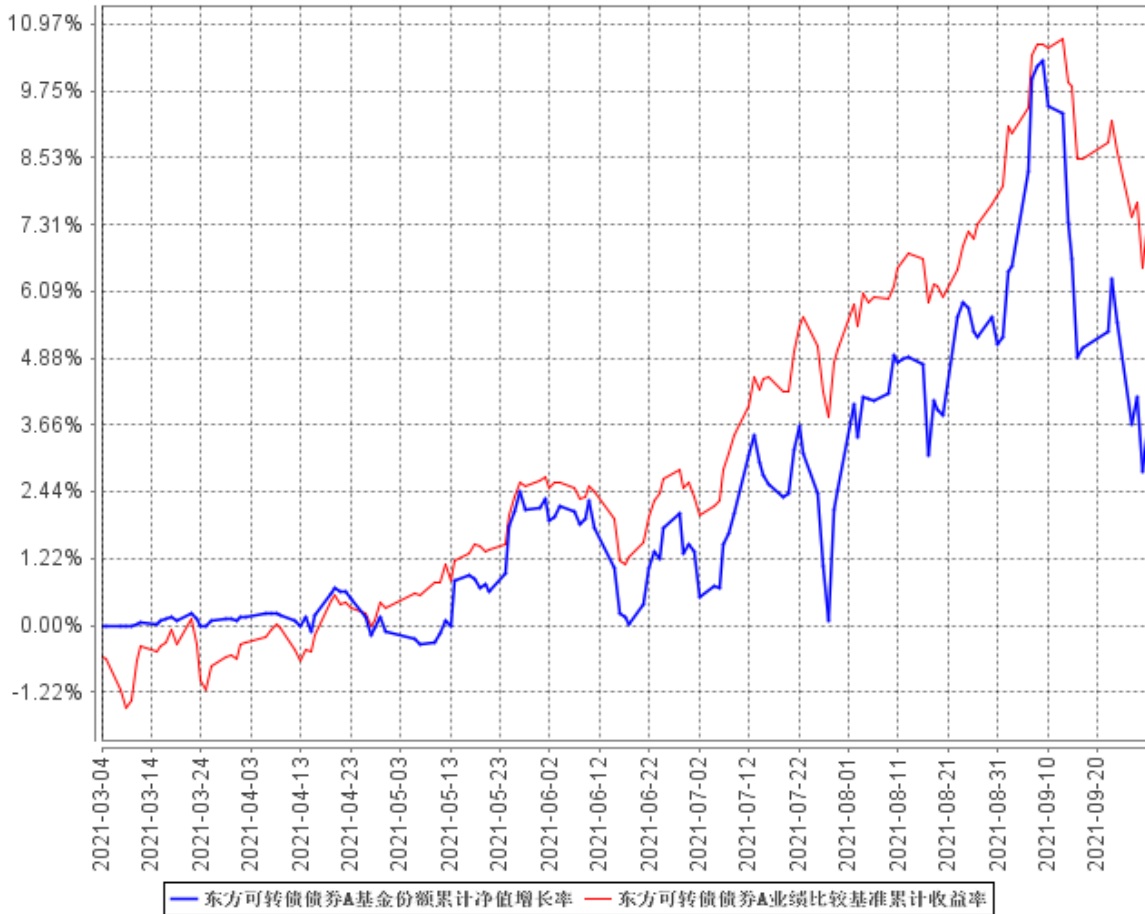
东方可转债债券 C

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	2.05%	0.83%	4.72%	0.47%	-2.67%	0.36%
过去六个月	3.37%	0.63%	8.12%	0.38%	-4.75%	0.25%
自基金合同生效起至今	3.43%	0.59%	7.45%	0.38%	-4.02%	0.21%

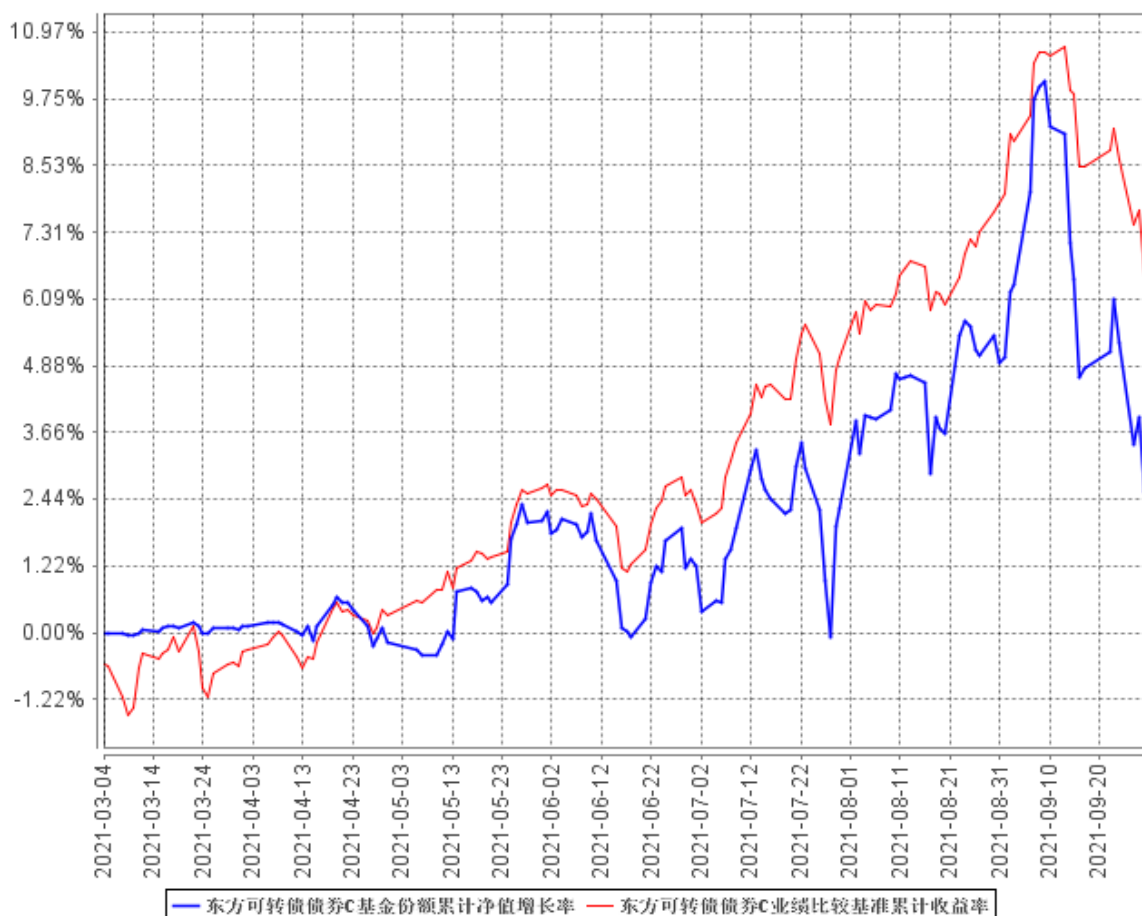
至今						
----	--	--	--	--	--	--

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

东方可转债债券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



东方可转债债券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



注：本基金基金合同于 2021 年 3 月 4 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		
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	2021 年 3 月 4 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

	<p>资 决 策 委 员 会 副 主 任 委 员</p>			<p>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、东方兴润债券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。

4.1.1 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、《东方可转债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，未直接或通过与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 年三季度，全球经济继续回暖，大宗商品价格出现持续上涨，美国 CPI 持续超过 5%，美联储收紧货币的预期开始加强。反观中国，由于率先收紧货币且对房地产进行持续调控，出现了经济回落、流动性有所紧张、PPI 持续走高并存的“类滞涨”现象。在此背景下，国内货币政策和财政政策预期出现紊乱。

三季度美债收益率出现持续上行，美股也在 9 月回落。国内市场债券收益率跟随上行，股市也出现了明显调整，整体走势较弱且结构分化严重。除新能源、新能源车、及上游原材料相关行业外，A 股多数行业走势疲弱，赚钱效应较差。可转债方面，三季度走势较好，转债指数创出 6 年新高后出现冲高回落。

个人认为，目前国内采取的解决经济中中长期的隐患，如推进“双碳”、消化已成为灰犀牛的房地产泡沫、纾解互联网巨头垄断、教育“双减”等，都是利在千秋的好事，但这些政策叠加在一起，会对我们的经济造成一定冲击，需要谨慎对待。在出口预期回落的情况下，未来两个季度经济增速可能将继续出现回落。

报告期间，本基金在股票方面适度均衡配置，不追热点，维持中等股票仓位，持仓集中于大消费+大金融两大板块，少量持有周期龙头和科技板块。具体个股上基本以行业龙头为主。减持了部分涨起来的热门股票和高价转债，同时增加了低估值价值股和低价转债的配置比例。

从净值表现结果来看，三季度可转债基金净值表现一般，与预期有不小差距。市场震荡格局下需要保持平和心态。随着市场炒作热点的下降，组合中价值类股票和低价转债正在逐渐走出底

部。个人对自己的持仓耐心静待花开，力争在四季度多创造收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2021 年 7 月 1 日起至 2021 年 9 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为 2.15%，业绩比较基准收益率为 4.72%，低于业绩比较基准 2.57%；本基金 C 类净值增长率为 2.05%，业绩比较基准收益率为 4.72%，低于业绩比较基准 2.67%。

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，受基金份额持有人赎回等影响，本基金存在基金资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情况，持续期间为 2021 年 8 月 3 日至 2021 年 9 月 9 日。

§ 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	7,597,044.40	9.02
	其中：股票	7,597,044.40	9.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	73,829,497.45	87.67
	其中：债券	73,829,497.45	87.67
	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	356,823.65	0.42
8	其他资产	2,428,272.04	2.88
9	合计	84,211,637.54	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	174,000.00	0.27
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,975,652.40	6.20
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	297,600.00	0.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	251,370.00	0.39
J	金融业	2,459,222.00	3.84
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	439,200.00	0.69
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	7,597,044.40	11.85

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	600352	浙江龙盛	40,000	540,800.00	0.84
2	600958	东方证券	35,000	529,550.00	0.83
3	002027	分众传媒	60,000	439,200.00	0.69
4	601108	财通证券	40,000	432,400.00	0.67
5	300777	中简科技	8,000	432,000.00	0.67
6	000776	广发证券	20,000	419,200.00	0.65
7	603501	韦尔股份	1,600	388,176.00	0.61
8	600438	通威股份	7,000	356,580.00	0.56
9	600409	三友化工	30,000	334,200.00	0.52
10	600862	中航高科	10,000	325,700.00	0.51

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	2,560,734.80	4.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,357,425.00	2.12
	其中：政策性金融债	1,357,425.00	2.12
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）	69,911,337.65	109.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	73,829,497.45	115.19

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	113043	财通转债	38,390	4,334,998.80	6.76
2	123107	温氏转债	37,000	4,175,080.00	6.51
3	110062	烽火转债	33,990	3,672,619.50	5.73
4	113044	大秦转债	34,000	3,587,680.00	5.60
5	110067	华安转债	30,000	3,367,800.00	5.25

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

本基金所持有的韦尔股份（603501）因未及时披露公司重大事项，被中国证券监督管理委员会上海监管局于 2021-05-01 依据相关法规给予出具警示函处分决定。违规行为：上海韦尔半导体股份有限公司（以下简称“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，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。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值约占最近一期经审计总资产 37%。公司对于上述资产质押情况未及在临时公告中披露，直至 2020 年 4 月 10 日才在 2019 年年度报告中披露。

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。

本基金所持有的中简科技（300777）公司股东袁怀东、施秋芳因未及时披露公司重大事项，未依法履行其他职责，于 2021 年 6 月 18 日被深圳证券交易所采取出具监管函的措施。违规行为：2021 年 6 月 18 日，袁怀东、施秋芳通过中简科技股份有限公司（以下简称“公司”）披露了《简式权益变动报告（更新后）》。公告显示，袁怀东、施秋芳作为一致行动人，在 2020 年 8 月 27 日至 2021 年 6 月 10 日期间，通过集中竞价和大宗交易的方式合计减持公司股份 22,448,850 股，占公司总股本的 5.61%。在合计持有公司股份比例变动达 5%时，没有及时披露权益变动报告书，在履行披露义务前也没有停止卖出公司股票。上述行为违反了《证券法》第六十三条、《上市公司收购管理办法》第十三条、《创业板股票上市规则（2020 年修订）》《创业板股票上市规则（2020 年 12 月修订）》第 2.3.1 条的规定。

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。

本基金所持有温氏转债（123107），发行人温氏食品集团股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因未及时披露公司重大事项，未依法履行其他职责，被中国证券监督管理委员会、深圳证券交易所处罚。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。

本基金所持有华安转债（110067），发行人华安证券股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因未及时披露公司重大事项，未依法履行其他职责，被中国证券监督管理委员会处罚。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。

本基金所持有苏行转债（127032），发行人苏州银行股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责，被中国银行保险监督管理委员会、中国银行业监督管理委员会处罚。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。

本基金投资中简科技主要基于以下原因：公司作为碳纤维行业龙头具备长期投资价值，碳纤维在我国未来有较大的使用上升空间。

本基金投资温氏转债主要基于以下原因：

目前生猪价格处于周期底部，后续猪价上升可能带动正股上涨，并且转债价格处于较低价位，性价比较高。

本基金投资华安转债主要基于以下原因：

股市交易热情高带动交易量持续处于较高水平，看好因此受益的券商板块。

本基金投资苏行转债主要基于以下原因：

由于低基数原因，银行板块今年盈利较好，并且正股和转债估值价格均较低，具备较大的投资安全边际。

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	25,996.39
2	应收证券清算款	2,151,270.23
3	应收股利	-
4	应收利息	169,479.29
5	应收申购款	81,526.13
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,428,272.04

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	113043	财通转债	4,334,998.80	6.76
2	110062	烽火转债	3,672,619.50	5.73
3	113044	大秦转债	3,587,680.00	5.60
4	110067	华安转债	3,367,800.00	5.25

5	110073	国投转债	2,646,150.00	4.13
6	113619	世运转债	2,259,390.00	3.52
7	128116	瑞达转债	1,968,430.00	3.07
8	113024	核建转债	1,964,180.00	3.06
9	127012	招路转债	1,658,737.50	2.59
10	110075	南航转债	1,484,740.00	2.32
11	128122	兴森转债	1,479,979.62	2.31
12	128117	道恩转债	1,375,660.00	2.15
13	127005	长证转债	1,255,200.00	1.96
14	123101	拓斯转债	1,220,780.00	1.90
15	110051	中天转债	1,183,800.00	1.85
16	123039	开润转债	1,179,461.00	1.84
17	128129	青农转债	1,134,188.37	1.77
18	128131	崇达转 2	1,080,888.90	1.69
19	128121	宏川转债	1,071,987.21	1.67
20	110057	现代转债	1,048,410.00	1.64
21	113042	上银转债	1,007,151.00	1.57
22	113021	中信转债	993,612.00	1.55
23	128123	国光转债	966,875.00	1.51
24	113608	威派转债	900,601.90	1.41
25	113030	东风转债	866,444.90	1.35
26	127021	特发转 2	846,640.00	1.32
27	110063	鹰 19 转债	823,722.00	1.29
28	123084	高澜转债	703,900.00	1.10
29	128132	交建转债	680,758.80	1.06
30	113597	佳力转债	657,720.00	1.03
31	128138	侨银转债	653,640.00	1.02
32	127020	中金转债	598,800.00	0.93
33	128143	锋龙转债	590,550.00	0.92
34	127024	盈峰转债	582,854.34	0.91
35	127015	希望转债	570,900.00	0.89
36	128144	利民转债	559,971.44	0.87
37	123060	苏试转债	549,560.00	0.86
38	123096	思创转债	543,000.00	0.85
39	128125	华阳转债	518,200.00	0.81
40	128072	翔鹭转债	435,600.00	0.68
41	127011	中鼎转 2	419,250.00	0.65
42	128057	博彦转债	375,060.00	0.59
43	127025	冀东转债	347,580.00	0.54

44	123075	贝斯转债	338,580.00	0.53
45	113542	好客转债	323,940.00	0.51
46	123076	强力转债	251,970.40	0.39
47	113577	春秋转债	241,740.00	0.38
48	123081	精研转债	235,020.00	0.37
49	123059	银信转债	222,500.00	0.35
50	110068	龙净转债	218,560.00	0.34
51	123073	同和转债	206,159.20	0.32
52	113584	家悦转债	183,965.60	0.29
53	123044	红相转债	171,270.00	0.27
54	113603	东缆转债	141,470.00	0.22
55	128145	日丰转债	122,470.00	0.19
56	113596	城地转债	93,870.00	0.15

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	东方可转债债券 A	东方可转债债券 C
报告期期初基金份额总额	57,708,247.52	11,430,642.18
报告期期间基金总申购份额	11,379,763.87	21,091,890.78
减:报告期期间基金总赎回份额	31,199,736.99	8,523,388.06
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	37,888,274.40	23,999,144.90

§ 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	-	-	-	-	-	-	-
产品	1	20210922 - 20210930	-	14,301,612.86	-	14,301,612.86	23.11%
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、《东方可转债债券型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方可转债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

2021 年 10 月 26 日