

东方兴润债券型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 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：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 7 月 1 日起至 2022 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东方兴润债券	
基金主代码	012539	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 5 日	
报告期末基金份额总额	704,001,715.93 份	
投资目标	本基金在严格控制投资风险的基础上，争取为基金份额持有人谋求长期、稳健的投资回报。	
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。	
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+恒生指数收益率×5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，理论上其长期平均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。本基金将投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	东方基金管理股份有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东方兴润债券 A	东方兴润债券 C
下属分级基金的交易代码	012539	012540
报告期末下属分级基金的份额总额	644,489,930.83 份	59,511,785.10 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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）	
	东方兴润债券 A	东方兴润债券 C
1. 本期已实现收益	-12,955,834.66	-705,841.04
2. 本期利润	-26,484,968.64	-2,953,664.24
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0324	-0.0626
4. 期末基金资产净值	619,135,848.77	57,120,492.88
5. 期末基金份额净值	0.9607	0.9598

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

东方兴润债券 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	-3.65%	0.37%	-1.31%	0.11%	-2.34%	0.26%
过去六个月	-1.02%	0.39%	-0.71%	0.13%	-0.31%	0.26%
过去一年	-3.18%	0.37%	-1.22%	0.14%	-1.96%	0.23%
自基金合同生效起至今	-3.93%	0.36%	-1.89%	0.13%	-2.04%	0.23%

东方兴润债券 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	-3.68%	0.37%	-1.31%	0.11%	-2.37%	0.26%
过去六个月	-1.07%	0.39%	-0.71%	0.13%	-0.36%	0.26%
过去一年	-3.26%	0.37%	-1.22%	0.14%	-2.04%	0.23%

自基金合同 生效起至今	-4.02%	0.36%	-1.89%	0.13%	-2.13%	0.23%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

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

东方兴润债券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



东方兴润债券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



注：本基金基金合同于 2021 年 08 月 05 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	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	2021 年 8 月 5 日	-	17 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，17 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。

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、《东方兴润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

三季度美国通胀仍旧维持高位，联储不断加息收紧货币降温经济。欧洲通胀由于地缘政治因素更为严重，赖以依存的低价能源一去不返。受能源价格高启影响，日本出现多年不遇的持续贸易赤字。整体看西方发达国家在美元加息周期下经济前景堪忧，整体预期可能渐次陷入衰退。受此影响，欧美股市持续下跌，债券收益率出现进一步上行，以上现象均显示市场预计滞胀格局可能将延续。

国内来看，三季度后半段经济受海外通胀、地缘政治、国内疫情延续等负面因素影响，导致经济增长承压。面对增长压力，相关政策陆续出台，如降准降息和适度放松地产等政策，其对经济托底效果有待四季度观察。受此影响，国内股市三季度前半段延续了 5、6 月份的反弹趋势，而后半段受限于海内外负面因素出现了明显回调，仅小盘科技成长类股票有部分相对收益。债券市场先跌后涨，收益率出现下行，三季度获得难得的绝对收益。

本基金操作方面，三季度投资风格保持稳定。股票操作方面从价值略偏向成长，在 9 月份进行了一定的减仓操作，主要是减持了金融和消费板块，增持了智能制造军工等科技板块。个股持仓分散。可转债则一直保持了接近 20% 的仓位，个别高价转债被清仓，置换成了 120 以下的平衡型转债。纯债方面，信用债保持短久期高资质高仓位，获取正常票息；利率债方面，清仓了长久

期利率债。净值表现结果来看，跟随股市先扬后抑，三季度表现一般。在市场整体低迷的环境下，局部性的主动操作并未获得更好结果。往后看，各类不确定因素在四季度都将逐步落地，国内托底经济政策逐渐显露效果，因此我们仍会保持谨慎乐观心态，逐步开始买入优质资产，谨小慎微地去找市场机会，争取为客户创造较好收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2022 年 07 月 01 日起至 2022 年 09 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为-3.65%，业绩比较基准收益率为-1.31%，低于业绩比较基准 2.34%；本基金 C 类净值增长率为-3.68%，业绩比较基准收益率为-1.31%，低于业绩比较基准 2.37%。

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	103,087,862.25	12.68
	其中：股票	103,087,862.25	12.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	651,896,371.84	80.20
	其中：债券	651,896,371.84	80.20
	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	-10,850.54	-0.00
	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	4,312,630.82	0.53
8	其他资产	53,582,603.77	6.59
9	合计	812,868,618.14	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	-	-
C	制造业	85,723,137.67	12.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	921,200.00	0.14
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,923,480.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	866,700.00	0.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,845,740.00	0.57
J	金融业	-	-
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	3,820,250.00	0.56
N	水利、环境和公共设施管理业	588,300.00	0.09
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	97,688,807.67	14.45

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	2,438,370.24	0.36
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	2,960,684.34	0.44
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	5,399,054.58	0.80

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	000858	五粮液	27,000	4,569,210.00	0.68
2	000661	长春高新	15,000	2,555,250.00	0.38
3	002747	埃斯顿	135,000	2,540,700.00	0.38

4	00388	香港交易所	10,000	2,438,370.24	0.36
5	688065	凯赛生物	40,000	2,408,000.00	0.36
6	600765	中航重机	80,000	2,396,800.00	0.35
7	688768	容知日新	20,813	2,121,052.83	0.31
8	002384	东山精密	90,000	2,083,500.00	0.31
9	002430	杭氧股份	60,000	2,057,400.00	0.30
10	02382	舜宇光学科技	30,000	2,039,059.98	0.30

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	26,595,032.32	3.93
2	央行票据	-	-
3	金融债券	209,282,963.97	30.95
	其中：政策性金融债	9,765,774.66	1.44
4	企业债券	77,353,219.73	11.44
5	企业短期融资券	40,497,019.18	5.99
6	中期票据	164,990,644.92	24.40
7	可转债（可交换债）	133,177,491.72	19.69
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	651,896,371.84	96.40

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	152851	21 蓉高 G1	400,000	41,286,794.52	6.11
2	2020007	20 北京银行小微债 01	400,000	40,777,227.40	6.03
3	102101618	21 武汉城建 MTN003	400,000	40,576,357.26	6.00
4	012280900	22 越秀集团 SCP006	400,000	40,497,019.18	5.99
5	102100292	21 南电 MTN001	300,000	31,244,633.42	4.62

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 21 招证 G2 (175638)，发行人招商证券股份有限公司（以下简称“公司”），于 2022 年 9 月 5 日受到行政处罚。公司因 2014 年在开展上海飞乐股份有限公司（现中安科股份有限公司）独立财务顾问业务期间未勤勉尽责，涉嫌违法违规，被中国证券监督管理委员会处罚。公司目前经营一切正常，财务状况稳健，上述处罚不会对业务经营及偿债能力造成重大影响。

本基金所持有 21 南京银行 01 (2120116)，发行人南京银行股份有限公司（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 20 北京银行小微债 01 (2020007)，发行人北京银行股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责，未及时披露公司重大事项，被中国证券监督管理委员会、中国人民银行、中国银行保险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 21 浦发银行 02 (2128046)，发行人上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责，未及时披露公司重大事项，被中国人民银行、中国银行保险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 21 招证 G2 主要基于以下原因：

发行人为国内头部券商，大股东实力雄厚，违约风险较低。

本基金投资 21 南京银行 01、20 北京银行小微债 01、21 浦发银行 02 主要基于以下原因：

银行业估值处于较低位置，同时转债外部评级较高，整体安全边际较强。

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	169,961.59
2	应收证券清算款	53,412,391.27
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	250.91
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	53,582,603.77

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	113633	科沃转债	5,472,061.34	0.81
2	128131	崇达转 2	5,283,964.93	0.78
3	110082	宏发转债	5,051,738.85	0.75
4	113638	台 21 转债	4,445,277.70	0.66
5	127052	西子转债	4,163,462.08	0.62
6	123117	健帆转债	3,947,985.62	0.58
7	123101	拓斯转债	3,862,063.01	0.57
8	113632	鹤 21 转债	3,842,531.07	0.57
9	123065	宝莱转债	3,445,175.34	0.51
10	123124	晶瑞转 2	3,305,508.04	0.49
11	113623	风 21 转债	3,294,086.30	0.49
12	123075	贝斯转债	3,077,943.78	0.46
13	110058	永鼎转债	2,835,308.22	0.42
14	128123	国光转债	2,731,975.17	0.40
15	123108	乐普转 2	2,693,133.01	0.40
16	127056	中特转债	2,593,147.92	0.38
17	113045	环旭转债	2,441,512.36	0.36
18	113542	好客转债	2,428,372.05	0.36
19	113524	奇精转债	2,326,334.25	0.34
20	123122	富瀚转债	2,294,027.40	0.34
21	113624	正川转债	2,274,916.19	0.34
22	113573	纵横转债	2,273,047.57	0.34
23	128136	立讯转债	2,223,710.69	0.33
24	127046	百润转债	2,221,152.30	0.33
25	123126	瑞丰转债	2,171,623.59	0.32
26	123115	捷捷转债	2,154,623.42	0.32
27	128039	三力转债	2,078,965.48	0.31
28	113574	华体转债	2,036,771.01	0.30
29	113641	华友转债	2,022,932.00	0.30
30	128049	华源转债	1,907,614.25	0.28
31	128125	华阳转债	1,842,257.40	0.27
32	113608	威派转债	1,655,252.47	0.24
33	127041	弘亚转债	1,645,247.26	0.24
34	118000	嘉元转债	1,514,491.10	0.22
35	113546	迪贝转债	1,428,625.64	0.21

36	113639	华正转债	1,406,204.66	0.21
37	123113	仙乐转债	1,401,360.82	0.21
38	128072	翔鹭转债	1,331,976.99	0.20
39	123109	昌红转债	1,230,687.23	0.18
40	123077	汉得转债	1,228,188.16	0.18
41	128121	宏川转债	1,184,909.18	0.18
42	113616	韦尔转债	1,137,728.49	0.17
43	123132	回盛转债	1,118,002.44	0.17
44	113605	大参转债	1,100,923.84	0.16
45	128120	联诚转债	1,057,049.01	0.16
46	123104	卫宁转债	1,002,121.74	0.15
47	113053	隆 22 转债	925,634.38	0.14
48	123011	德尔转债	923,727.12	0.14
49	113579	健友转债	921,383.01	0.14
50	128118	瀛通转债	880,554.74	0.13
51	123142	申昊转债	842,586.74	0.12
52	128122	兴森转债	838,623.97	0.12
53	113593	沪工转债	784,714.00	0.12
54	123088	威唐转债	711,269.59	0.11
55	127022	恒逸转债	657,821.10	0.10
56	113566	翔港转债	592,527.40	0.09
57	127031	洋丰转债	588,891.10	0.09
58	123106	正丹转债	562,505.89	0.08
59	113604	多伦转债	523,521.10	0.08
60	113588	润达转债	506,935.48	0.07
61	123119	康泰转 2	489,021.92	0.07
62	113565	宏辉转债	488,021.59	0.07
63	128076	金轮转债	469,806.03	0.07
64	123116	万兴转债	395,167.16	0.06
65	118005	天奈转债	364,297.23	0.05
66	113594	淳中转债	342,418.11	0.05
67	118003	华兴转债	246,122.41	0.04
68	123061	航新转债	236,973.48	0.04
69	113049	长汽转债	234,298.14	0.03
70	128144	利民转债	234,262.36	0.03
71	123044	红相转债	227,910.52	0.03
72	111001	山玻转债	227,670.03	0.03
73	118004	博瑞转债	219,133.42	0.03
74	113628	晨丰转债	217,859.67	0.03

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	东方兴润债券 A	东方兴润债券 C
报告期期初基金份额总额	916,688,159.04	25,059,360.40
报告期期间基金总申购份额	16,869,124.02	49,796,002.78
减：报告期期间基金总赎回份额	289,067,352.23	15,343,578.08
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	644,489,930.83	59,511,785.10

§ 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	20220701 - 20220930	202,952,259.65	49,490,250.42	-	252,442,510.07	35.86

产品特有风险

基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。

(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。

(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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 一、《东方兴润债券型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方兴润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

2022 年 10 月 26 日