
东方新策略灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年一月十八日

§ 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 1 月 16 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	东方新策略灵活配置混合	
基金主代码	001318	
交易代码	001318	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 26 日	
报告期末基金份额总额	96,347,039.34 份	
投资目标	在严控风险的前提下，结合灵活的资产配置和多种投资策略，充分把握市场机会，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金通过对类别资产的灵活配置，调整不同时期内基金的整体风险与收益水平，并结合多种投资策略精选具有较高投资价值的股票和债券，获得基金的长期稳定增值。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中债总全价指数收益率×30%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。	
基金管理人	东方基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东方新策略灵活配置混合 A	东方新策略灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	001318	002060
报告期末下属分级基金的份额总额	96,346,935.39 份	103.95 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（2018年10月1日—2018年12月31日）	
	东方新策略灵活配置混合 A	东方新策略灵活配置混合 C
1. 本期已实现收益	-11,520,541.39	-12.20
2. 本期利润	-6,557,869.42	-6.78
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0675	-0.0652
4. 期末基金资产净值	88,925,547.11	98.24
5. 期末基金份额净值	0.9230	0.9451

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

东方新策略灵活配置混合 A

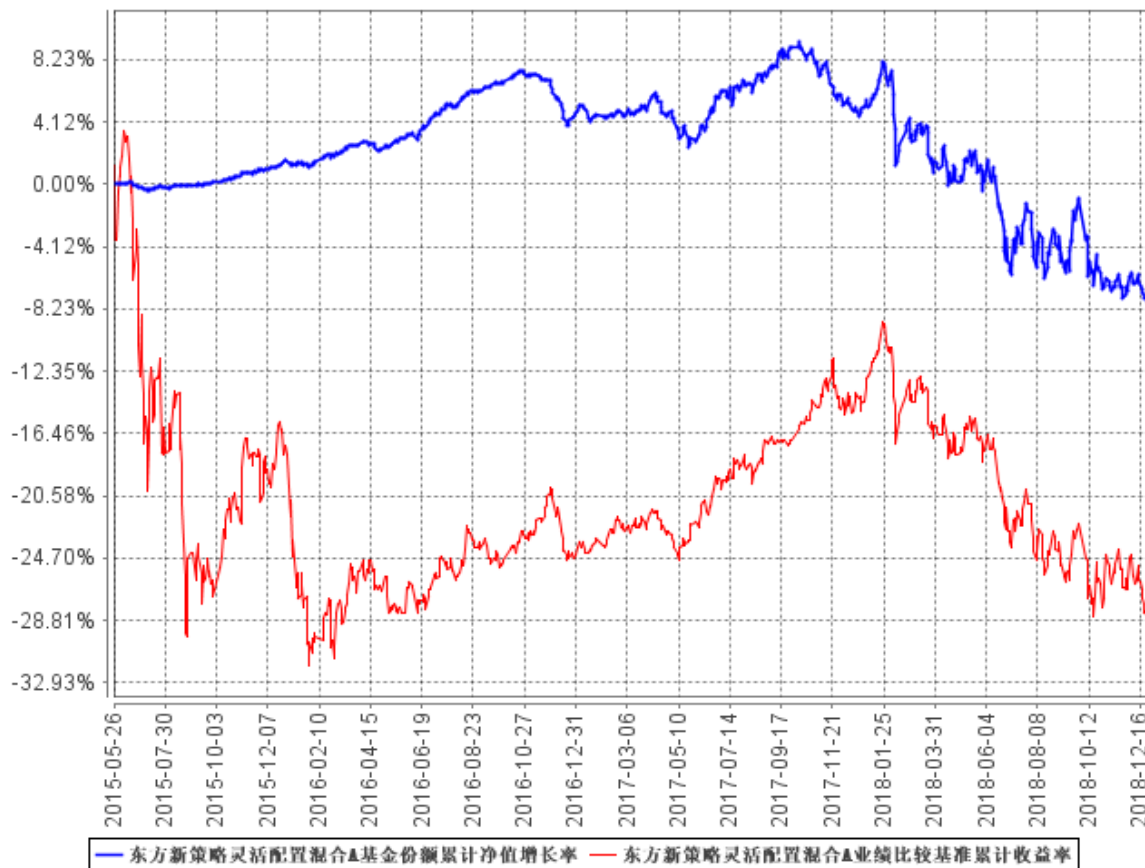
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.79%	0.66%	-7.93%	1.14%	1.14%	-0.48%

东方新策略灵活配置混合 C

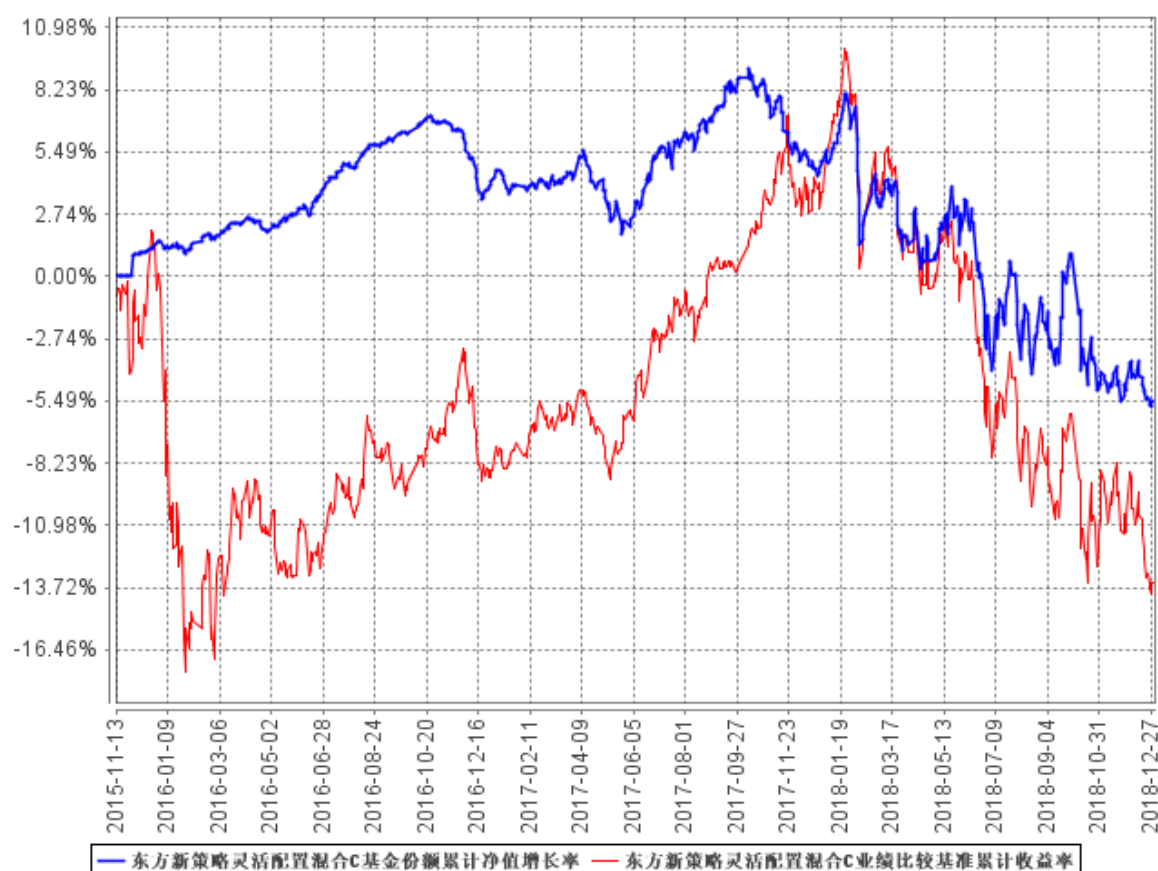
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.45%	0.66%	-7.93%	1.14%	1.48%	-0.48%

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

东方新策略灵活配置混合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



东方新策略灵活配置混合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



§ 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		
姚航(女士)	本基金基金经理、固定收益投资部副总经理、投资决策委员会委员	2015年5月26日	-	14年	固定收益投资部副总经理，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

					<p>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、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、东方稳健回报债券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。</p>
朱晓栋 (先生)	本基金经理、权益投资部副总经理、投资决策委员会委员	2015 年 5 月 26 日	-	9 年	<p>权益投资部副总经理, 对外经济贸易大学经济学硕士, 9 年证券从业经历。2009 年 12 月加盟东方基金管理有限责任公司, 曾任研究部金融行业、固定收益研究、食品饮料行业、建筑建材行业研究员, 投资决策委员会委员, 东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方核心动力股票型开放式证</p>

					券投资基金（于 2015 年 7 月 31 日转型为东方核心动力混合型证券投资基金）基金经理、东方区域发展混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理，现任东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理、东方鼎新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。
李瑞	本基金经理	2018 年 9 月 20 日	-	7 年	中国人民大学金融学硕士，7 年证券从业经历。2011 年 7 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，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（于 2018 年 6 月 21 日起转型为东方新能源汽车主题混合型证券投资基金）基金经理，现任东方新能源汽车主题混合型证券投资基金基金经理、东方安心收益保本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。

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、《东方新策略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

正如我们此前在季度展望中描述的，对经济前景的悲观预期目前还没有完全反应在上市公司盈利预测上，所以市场很难立刻形成趋势性逆转。2018 年 4 季度，市场再度下跌，沪深 300 跌幅达到了 12.45%，全年累计跌幅 25.31%。中小板指跌幅最大，季度跌幅 18.22%，年度跌幅 37.75%。分行业看，2018 年 4 季度农林牧渔、电力设备、房地产、通信、公用事业、建筑、银行等板块跌幅较小，石油石化、钢铁、医药、食品饮料、基础化工跌幅较大。

本基金 4 季度维持了较低的仓位水平。10 月初进行了较大幅度减仓，主要对前期超配的消费类行业进行了减持，超配行业集中到金融、建筑等大盘蓝筹。11 月小仓位参与了反弹，对持仓进行了相对均衡化处理。截止 12 月底仓位仍维持在较低水平。

2018 年四季度，基本面下行兑现、宽货币带动流动性持续宽松、风险资产下挫带动避险情绪回升，政策组合继续延续“宽货币、宽信用”的基调。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。

2018 年四季度债券收益率整体下行，10 年国债、国开债收益率分别较三季度末下行 37BP、下行 57BP。信用市场方面，宽信用政策与民企违约交织，中低等级中被错杀品种的流动性有所好转，信用利差高位下行。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。

本基金后续操作中，将继续坚持优质核心资产作为主要投资方向的策略。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2018 年 10 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日，本基金 A 类净值增长率为-6.79%，业绩比较基准收益率为-7.93%，高于业绩比较基准 1.14%；本基金 C 类净值增长率为-6.45%，业绩比较基准收益率为-7.93%，高于业绩比较基准 1.48%。

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	19,222,064.50	21.50
	其中：股票	19,222,064.50	21.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	52,826,300.00	59.08
	其中：债券	52,826,300.00	59.08
	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	16,611,799.34	18.58
8	其他资产	752,519.79	0.84
9	合计	89,412,683.63	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	1,339,915.50	1.51
C	制造业	8,039,488.00	9.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,903,801.00	3.27
E	建筑业	1,255,710.00	1.41
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,087,450.00	1.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,314,340.00	2.60
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,787,600.00	2.01
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	493,760.00	0.56
S	综合	-	-
	合计	19,222,064.50	21.62

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	601668	中国建筑	220,300	1,255,710.00	1.41
2	600547	山东黄金	35,550	1,075,387.50	1.21
3	600340	华夏幸福	40,000	1,018,000.00	1.14
4	300568	星源材质	40,000	887,600.00	1.00
5	600886	国投电力	100,800	811,440.00	0.91
6	601006	大秦铁路	95,000	781,850.00	0.88
7	002372	伟星新材	50,000	775,500.00	0.87
8	002415	海康威视	30,000	772,800.00	0.87
9	600383	金地集团	80,000	769,600.00	0.87
10	601985	中国核电	135,300	713,031.00	0.80

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	10,024,000.00	11.27
	其中：政策性金融债	10,024,000.00	11.27
4	企业债券	27,914,800.00	31.39
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	14,887,500.00	16.74
9	其他	-	-
10	合计	52,826,300.00	59.41

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	111808326	18 中信银行	150,000	14,887,500.00	16.74

		CD326			
2	180207	18 国开 07	100,000	10,024,000.00	11.27
3	127158	PR 东营资	100,000	8,181,000.00	9.20
4	112298	15 新证债	80,000	7,928,800.00	8.92
5	1580309	15 无锡创投 债	60,000	5,960,400.00	6.70

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

本基金所持有的星源材质（300568）于 2018 年 11 月 9 日收到深交所创业板公司管理部出具的《关于对深圳市星源材质科技股份有限公司、原独立董事吴锋的监管函》（创业板监管函[2018]第 130 号）。该监管函主要内容为：

1、公司自查发现，时任独立董事吴锋自 2017 年 12 月起担任客户天津力神电池股份有限公司

的独立董事。自 2017 年 12 月起，公司及子公司与天津力神及其子公司之间发生的交易构成关联交易。2018 年 1 月 1 日至 2018 年 9 月 30 日，公司及子公司向天津力神及其子公司销售锂离子电池隔膜产品的交易金额（不含增值税）为 2917.40 万元，但公司迟至 2018 年 10 月 12 日才召开第四届董事会第十一次会议审议了《关于确认和预计公司与天津力神日常关联交易情况的议案》并进行了信息披露。吴锋在担任天津力神独立董事后未及时告知公司的行为，违反了《创业板股票上市规则（2014 年修订）》以及《创业板上市公司规范运作指引（2015 年修订）》的相关规定。

公司整改情况：公司在收到监管函后，立即将监管函转达至公司原独立董事吴锋，并组织公司现任董事、监事、高级管理人员及证券部相关人员就监管函涉及事项进行反省和总结。公司将吸取教训，加强对相关法律、法规和规则的学习，进一步加强信息披露工作管理，规范公司治理，杜绝此类问题再次发生，并于 2018 年 11 月 23 日向深圳证券交易所报送了《天风证券股份有限公司关于深圳市星源材质科技股份有限公司关联交易情况的专项现场检查报告》。

2、公司于 2018 年 3 月 23 日发布《关于控股股东、实际控制人进行股票质押式回购交易的公告》，称公司于 3 月 23 日接到控股股东、实际控制人陈秀峰的通知，其于 2018 年 3 月 6 日办理了 1770 万股公司股票质押，质押数量占公司总股本的 9.22%。该事项未及时通知并配合上市公司对上述质押业务予以披露，违反了《深圳证券交易所创业板股票上市规则》的相关规定。

公司整改情况：公司在收到监管函后，立即将监管函转达至控股股东、实际控制人陈秀峰，并组织公司现任董事、监事、高级管理人员及证券部相关人员就监管函涉及事项进行反省和总结。公司将吸取教训，加强对相关法律、法规和规则的学习，进一步加强信息披露工作管理，规范公司治理，杜绝此类问题再次发生。自收到监管函并进行充分学习、整改后，公司密切关注公司控股股东、实际控制人的股权质押、解除质押相关事宜，并对后续股权质押、解除质押相关事宜进行及时、充分的披露。

本基金决策依据及投资程序：

（1）研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究，形成有关的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

（2）投资决策委员会定期召开会议，讨论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范围形成本基金的资产配置比例指导意见。

（3）基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身的分析判断，形成基金投资计划，主要包括行业配置和投资组合管理。

（4）交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

(5) 投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施，监察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资星源材质主要基于以下原因：公司是国内早期进入隔膜领域的企业之一，也是第一家向国外出口干法隔膜的企业。公司在干法领域有着长达十几年之久的研发生产经验，技术积累深厚。渠道方面，公司干法产品在国际市场受到三星、LG 化学、日产等一线锂电厂商的青睐，产品订单数量可观。公司干法产品从生产环节到销售环节均占据着绝对优势，干法龙头地位稳固。

本基金所持有 18 中信银行 CD326 (111808326. IB)，发行人中信银行股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。于 2018 年 12 月 7 日，公司收到中国银行保险监督管理委员会的行政处罚决定，罚款 2280 万元。主要违法违规事实：(一)理财资金违规缴纳土地款。(二)自有资金融资违规缴纳土地款。(三)为非保本理财产品提供保本承诺。(四)本行信贷资金为理财产品提供融资。(五)收益权转让业务违规提供信用担保。(六)项目投资审核严重缺位。

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 18 中信银行 CD326 (111808326. IB) 主要基于以下原因：

18 中信银行 CD326 的债项评级为 AAA，主体评级为 AAA，表明发行人偿还债务的能力较强，受不利经济环境的影响不大，违约风险较低。

中信银行股份有限公司是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一，是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行，并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外，为中国经济建设做出了积极的贡献。公司作为国内资本实力最雄厚的商业银行之一，在中国经济发展的浪潮中快速成长，已经成为具有强大综合竞争力的全国性商业银行。公司坚持以客户为中心的经营理念，向企业和机构客户提供公司银行业务、国际业务、金融市场业务、机构业务、投资银行业务、同业业务、托管业务等综合金融解决方案；向个人客户提供一般零售银行、信用卡、消费金融、财富管理、私人银行、出国金融、电子银行等多元化金融产品及服务。全方位满足企业及个人客户的综合金融服务需求。

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	33,231.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	718,189.21
5	应收申购款	1,098.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	752,519.79
---	----	------------

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

项目	东方新策略灵活配置混合 A	东方新策略灵活配置混合 C
报告期期初基金份额总额	97,742,387.87	103.95
报告期期间基金总申购份额	98,111.66	-
减：报告期期间基金总赎回份额	1,493,564.14	-
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	96,346,935.39	103.95

§ 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

本报告期本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、《东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方新策略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）查阅。

东方基金管理有限责任公司

2019 年 1 月 18 日