

东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金

2019 年第 3 季度报告

2019 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：二〇一九年十月二十三日

§ 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 2019 年 10 月 22 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 2019 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 | 201,029,252.94 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 指数收益率×15%+中债总全价指数收益率×85% | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 东方成长收益灵活配置 | 东方成长收益灵活配 |

| | | |
|-----------------|------------------|--------------|
| | A | 置 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 400013 | 007687 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 200,894,161.95 份 | 135,090.99 份 |

注：报告期内，本基金自 2019 年 8 月 7 日起变更业绩比较基准、调整相关费率并增加收取销售服务费的 C 类基金份额，业绩比较基准变更后为“沪深 300 指数收益率×15%+中债总全价指数收益率×85%”，并自 2019 年 8 月 7 日起接受投资者对 C 类基金份额的申购和赎回。本基金的基金代码为：东方成长收益灵活配置混合 A，400013；东方成长收益灵活配置混合 C，007687。详情请参阅本基金管理人于 2019 年 8 月 5 日在《证券时报》及公司网站上披露的相关公告。

§ 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（2019 年 7 月 1 日 — 2019 年 9 月 30 日） | |
|-----------------|---------------------------------------|--------------|
| | 东方成长收益灵活配置 A | 东方成长收益灵活配置 C |
| 1. 本期已实现收益 | -6,412,016.49 | 704.23 |
| 2. 本期利润 | -6,929,258.77 | 938.26 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0452 | 0.0149 |
| 4. 期末基金资产净值 | 205,012,893.45 | 138,224.22 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0205 | 1.0232 |

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

东方成长收益灵活配置 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 | -3.19% | 0.36% | -0.37% | 0.22% | -2.82% | 0.14% |

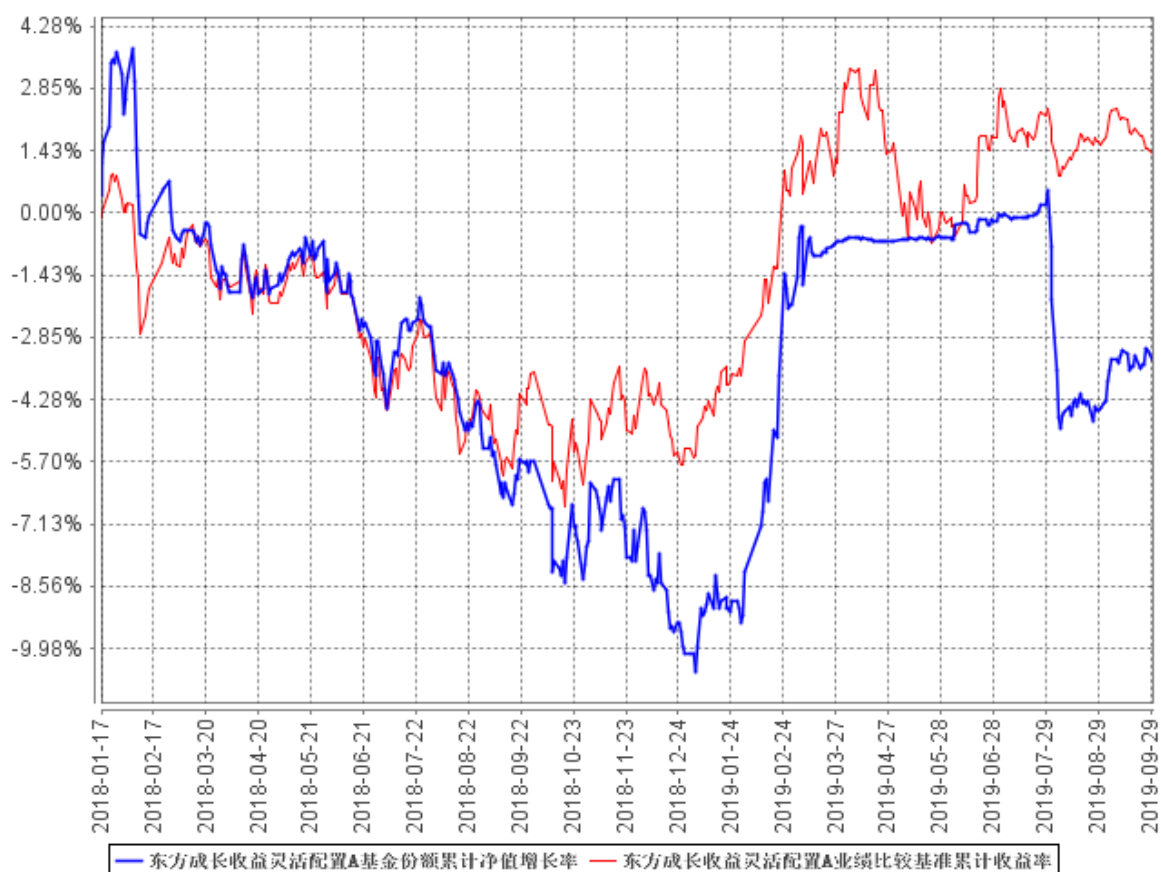
东方成长收益灵活配置 C

| 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 |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
| | | | | | | |

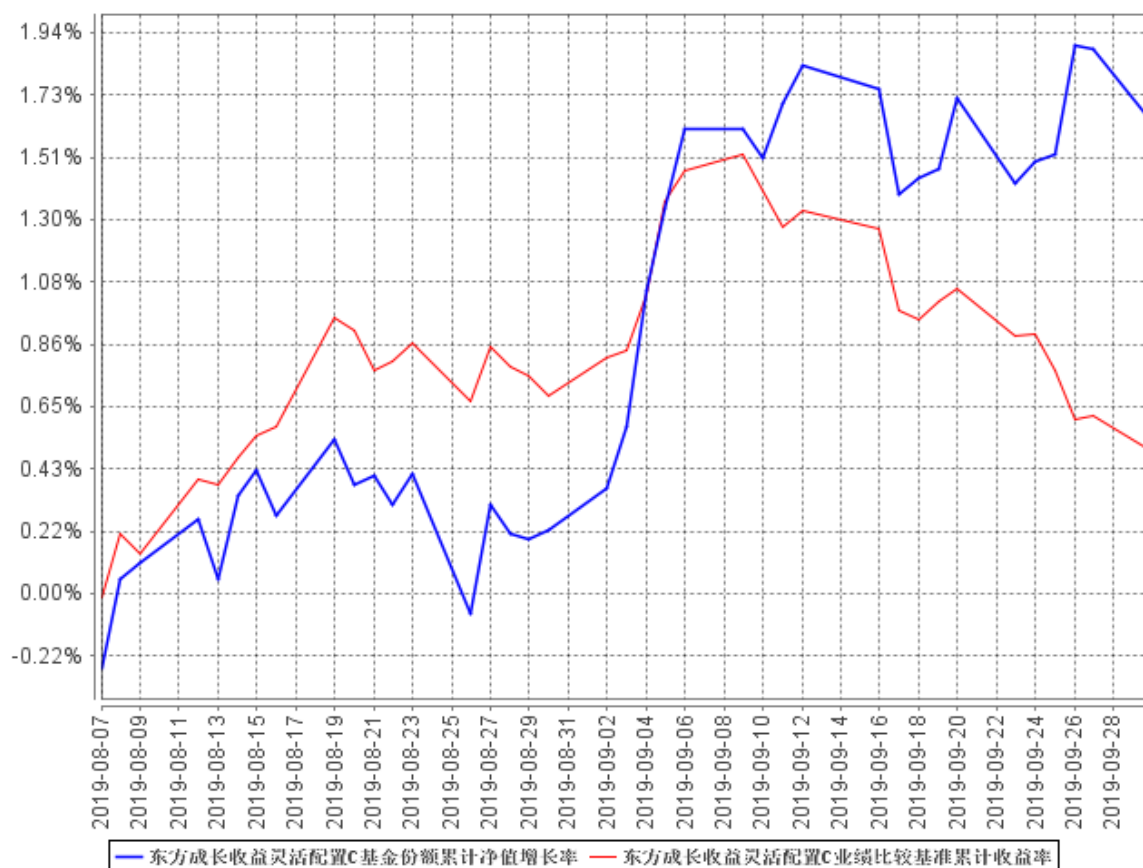
| | | | | | | |
|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 过去三个月 | 1.63% | 0.22% | 0.49% | 0.14% | 1.14% | 0.08% |
|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|

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



东方成长收益灵活配置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 | | |
| 薛子微 | 本基金基金经理 | 2019年8月29日 | - | 12 | 山西大学工商管理、应用心理学专业学士，12年证券从业经历。曾任中宣部政研所研究员、中信基金管理有限责任公司助理研究员、华夏基金管理有限公司研究员。2009年7月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任权益投资部房地产、综合、汽车、国防军工、机械设备行业研究员，投资经理、东方核心 |

| | | | | | |
|----|-------|-----------------|-----------------|---|--|
| | | | | | <p>动力股票型开放式证券投资基金（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、东方互联网嘉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、东方睿鑫热点挖掘灵活配置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、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（自 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，现任东方新价值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、东方周期优选灵活配置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。</p> |
| 郭瑞 | 本基金经理 | 2018 年 1 月 17 日 | 2019 年 8 月 29 日 | 8 | <p>中国科学院研究生院概率论与数理统计硕士，8 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）基金经理、东方惠新灵活配置混合</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 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。 |
|--|--|--|--|--|--|

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的同向交易价差、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

2019 年三季度市场整体下浮下跌，结构分化十分明显，一方面金融地产建筑等传统板块因中央明确表态不做短期刺激出现显著下跌；另一方面，受科创板开板，以及国家明确表明支持创新等带动，电子、计算机等行业表现出大幅上涨。

总体看，各行业表现差异较大，其中电子上涨 20.2%、医药上涨 6.36%、计算机上涨 5.4%位居前三；而钢铁下跌 11.06%、采掘下跌 8.25%、建筑下跌 7.68%跌幅居前。

本基金三季度仍然集中配置在绝对估值低，盈利好于市场预期的金融、地产行业，以及稳定增长的消费龙头公司。考虑三季度市场经历了一轮风险偏好修复带来的反弹，未来可能面临外围市场潜在波动加大、国内通胀对于流动性形成短期掣肘等负面因素，本基金在季度末一定程度上降低了权益市场仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2019 年 7 月 1 日起至 2019 年 9 月 30 日，本基金 A 类净值增长率为-3.19%，业绩比较基准收益率为-0.37%，低于业绩比较基准 2.82%；本基金 C 类净值增长率为 1.63%，业绩比较基准收益率为 0.49%，高于业绩比较基准 1.14%。

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 | 71,806,812.34 | 34.70 |
| | 其中：股票 | 71,806,812.34 | 34.70 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 84,869,750.00 | 41.01 |
| | 其中：债券 | 84,869,750.00 | 41.01 |
| | 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 | 40,090,180.14 | 19.37 |
| | 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 | 8,492,183.93 | 4.10 |
| 8 | 其他资产 | 1,668,546.50 | 0.81 |
| 9 | 合计 | 206,927,472.91 | 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 | 4,605,942.24 | 2.25 |
| 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 | 223,129.40 | 0.11 |
| J | 金融业 | 60,228,341.00 | 29.36 |
| K | 房地产业 | 6,749,399.70 | 3.29 |
| 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 | 71,806,812.34 | 35.00 |

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 | 601818 | 光大银行 | 2,773,300 | 10,926,802.00 | 5.33 |
| 2 | 601398 | 工商银行 | 1,907,300 | 10,547,369.00 | 5.14 |
| 3 | 601988 | 中国银行 | 2,920,900 | 10,456,822.00 | 5.10 |
| 4 | 601939 | 建设银行 | 1,479,000 | 10,338,210.00 | 5.04 |
| 5 | 601288 | 农业银行 | 2,985,300 | 10,329,138.00 | 5.03 |
| 6 | 601328 | 交通银行 | 1,400,000 | 7,630,000.00 | 3.72 |
| 7 | 000043 | 中航善达 | 340,970 | 5,799,899.70 | 2.83 |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 80,000 | 4,584,000.00 | 2.23 |
| 9 | 001979 | 招商蛇口 | 50,000 | 949,500.00 | 0.46 |
| 10 | 688368 | 晶丰明源 | 2,557 | 144,930.76 | 0.07 |

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 | 14,859,750.00 | 7.24 |
| | 其中：政策性金融债 | 12,147,600.00 | 5.92 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 70,010,000.00 | 34.13 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 84,869,750.00 | 41.37 |

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 | 071900103 | 19 国信证券 CP008 | 160,000 | 15,998,400.00 | 7.80 |

| | | | | | |
|---|-----------|-------------------|---------|---------------|------|
| 2 | 011902148 | 19 鲁高速股 SCP007 | 140,000 | 13,998,600.00 | 6.82 |
| 3 | 170209 | 17 国开 09 | 120,000 | 12,147,600.00 | 5.92 |
| 4 | 011901830 | 19 国联 SCP006 | 100,000 | 10,006,000.00 | 4.88 |
| 5 | 011901835 | 19 鲁黄金 SCP008 | 100,000 | 10,006,000.00 | 4.88 |

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本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金所持有的工商银行（601398）于 2019 年 8 月收到中国银行业监督管理委员会江西监管局对公司旗下南昌分行公开处罚 20 万元，违规行为为“双录”不符合监管要求。2019 年 8 月收到中国银行业监督管理委员会湛江监管局对公司旗下湛江金地支行公开处罚 20 万元，违规行为为中国工商银行股份有限公司湛江金地支行贷款业务严重违反审慎经营规则。

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的农业银行（601288）收到中国银行业监督管理委员会地方监管局对公司旗下

焦作分行、富锦市支行、梨树县支行、深圳市分行、信用卡中心、岳阳分行东乡族自治县支行、宁波市分行、温州分行、重庆南岸支行、铁门关兵团分行、鞍山分行、广西区分行、泉州分行、厦门市分行、上海徐汇淮海中路支行、上海奉贤支行、黄山昱城支行、鄂温克族自治旗支行、葫芦岛支行、钦州分行、大连市分行、淄博分行、偃师市支行、咸宁分行、广州淘金支行、十堰分行、阳江分行、榆林分行、南充顺庆支行、格尔木分行、济宁分行等分支机构进行处罚，违规类型为未依法履行其他职责。

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的中国银行（601988）收到中国银行业监督管理委员会地方监管局对公司旗下张家界天门路支行、龙游县支行、福安支行、云南省分行、广西区分行、山东省分行、巴彦浩特分行、呼和浩特市支行、内蒙古自治区分行、天津市分行、宝鸡分行、内蒙古自治区分行、大连市分行、淄博市分行、广东省分支行、张家界分行、武汉市分支行、淮北分行、深圳市分行、阳江分行、百色分行、襄阳分行、厦门市分行、信阳分行、徐州分行等分支机构进行处罚，违规类型为未依法履行其他职责。

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的建设银行（601939）青海省分行等多个分支机构被中国银行业监督管理委员会无锡监管分局等地方监管机构处以多起罚款。主要违法违规事实涉及信贷违规、销售违规等。

本基金所持有的交通银行（601328）于 2018/12/8 公告，公司被中国银行保险监督管理委员会罚款 690 万元。主要违法违规事实：（一）不良信贷资产未洁净转让，理财资金投资本行不良信贷资产收益权；（二）未尽调查并使用自有资金垫付承接风险资产；（三）档案管理不到位，内控管理存在严重漏洞；（四）理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模；（五）违规向土地储备机构提供融资；（六）信贷资金违规承接本行表外理财资产；（七）理财资金违规投资项目资本金；（八）部分理财产品信息披露不合规；（九）现场检查配合不力。

本基金所持有的交通银行（601328）于 2018/12/7 公告，公司被中国银行保险监督管理委员会罚款 50 万元。主要违法违规事实：并购贷款占并购交易价款比例不合规；并购贷款尽职调查和风险评估不到位。

本基金所持有的交通银行（601328）于 2018/10/24 公告，公司被中国保险监督管理委员会上海保监局罚款 34 万元。主要违法违规事实：一、欺骗投保人，2016 年 1 月至 2017 年 6 月期间，电销坐席在电话销售保险产品时，使用与事实不符的表述向投保人促销。问题类型包括电销坐席夸大保险责任或保险产品收益、利用营销手段进行不实宣传以及对国家关于保险的政策进行不实宣传等。二、向投保人隐瞒与合同有关的重要情况，2016 年 1 月至 2017 年 6 月期间，电销坐席在电

话销售保险产品时，存在未介绍或未完整介绍保险合同中涉及保险消费者核心权益内容的问题。

本基金所持有的格力电器（000651）于 2019 年 2 月收到中国证券监督管理委员会广东监管局对公司董事长董明珠出具警示函的行政监管措施。违规类型为未依法履行其他职责。违规行为为：公司董事长董明珠在 2019 年 1 月 16 日下午召开的格力电器 2019 年第一次临时股东大会上发布了格力电器 2018 年营业收入和净利润等有关业绩信息，而公司在股东大会结束后的当天晚间才发布 2018 年度业绩预告。

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

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。

本基金投资工商银行主要基于以下原因：公司是国内四大国有银行之一，业务结构稳健，PB 估值便宜且股息率高，具备配置价值。

本基金投资农业银行主要基于以下原因：公司是国内四大国有银行之一，业务结构稳健，PB 估值便宜且股息率高，具备配置价值。

本基金投资中国银行主要基于以下原因：公司是国内四大国有银行之一，业务结构稳健，PB 估值便宜且股息率高，具备配置价值。

本基金投资建设银行主要基于以下原因：公司是国内四大国有银行之一，业务结构稳健，PB 估值便宜且股息率高，具备配置价值。

本基金投资交通银行主要基于以下原因：公司是国内龙头银行，业务结构稳健，业绩稳定，资产质量好于行业竞争对手，具备长期投资价值。

本基金投资格力电器主要基于以下原因：公司是全球空调制造龙头公司，拥有非常强的护城河和壁垒，寡头竞争格局难以改变，公司将保持稳健增长，看好公司长期投资价值。

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 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 174,170.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,217,198.64 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 258,503.96 |
| 5 | 应收申购款 | 18,673.90 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,668,546.50 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 688368 | 晶丰明源 | 144,930.76 | 0.07 | 新股未上市 |

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 东方成长收益灵活配置 A | 东方成长收益灵活配置 C |
|--------------------|----------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 48,936,048.09 | - |
| 报告期期间基金总申购份额 | 177,459,488.01 | 182,518.24 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 25,501,374.15 | 47,427.25 |
| 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 | 200,894,161.95 | 135,090.99 |

§ 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 | 20190701 - 20190725 | 16,428,982.17 | - | 16,428,982.17 | - | - |
| | 2 | 20190807 - 20190930 | - | 56,693,754.13 | - | 56,693,754.13 | 28.20% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 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）查阅。

东方基金管理有限责任公司

2019 年 10 月 23 日