

# 东方成长回报平衡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 8 月 2 日（基金合同生效日）起至 9 月 30 日止。

东方成长回报平衡混合型证券投资基金由东方安心收益保本混合型证券投资基金（以下简称“东方安心收益保本”）转型而来，东方安心收益保本的第二个保本周期于 2019 年 7 月 29 日到期。因不再符合避险策略基金存续条件，已按基金合同的约定转型为非保本的混合型基金，即“东方成长回报平衡混合型证券投资基金”。转型后的东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金合同于 2019 年 8 月 2 日起正式生效。上述转型事项已按照法律法规的规定及基金合同的约定履行相应程序，详情请参阅本基金管理人于 2019 年 7 月 15 日、2019 年 7 月 16 日及 2019 年 7 月 22 日、2019 年 8 月 7 日在《中国证券报》及公司网站上披露的相关公告。

## § 2 基金产品概况

转型后：

基金简称	东方成长回报平衡混合
基金主代码	400020
交易代码	400020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 8 月 2 日
报告期末基金份额总额	54,800,855.37 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	本基金采用自上而下的大类资产配置与自下而上的个股选择相结合的投资策略。
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

转型前:

基金简称	东方安心收益保本
基金主代码	400020
交易代码	400020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 7 月 3 日
报告期末基金份额总额	104,469,769.83 份
投资目标	通过固定收益类资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理,控制本金损失的风险,并在基金本金安全的基础上实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将综合运用固定比例投资组合保险策略与基于期权的投资组合保险策略在保本周期内实现保值增值的目的。
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金是保本混合型的基金产品,属于证券投资基金中的低风险品种。
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 (转型后)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 ( 2019 年 8 月 2 日 — 2019 年 9 月 30 日 )
1. 本期已实现收益	81,426.71
2. 本期利润	252,286.13
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0038
4. 期末基金资产净值	56,497,721.24
5. 期末基金份额净值	1.0310

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。

### 3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年7月1日—2019年8月1日）
1. 本期已实现收益	6,814,883.46
2. 本期利润	977,847.84
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0019
4. 期末基金资产净值	107,357,022.80
5. 期末基金份额净值	1.0276

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。

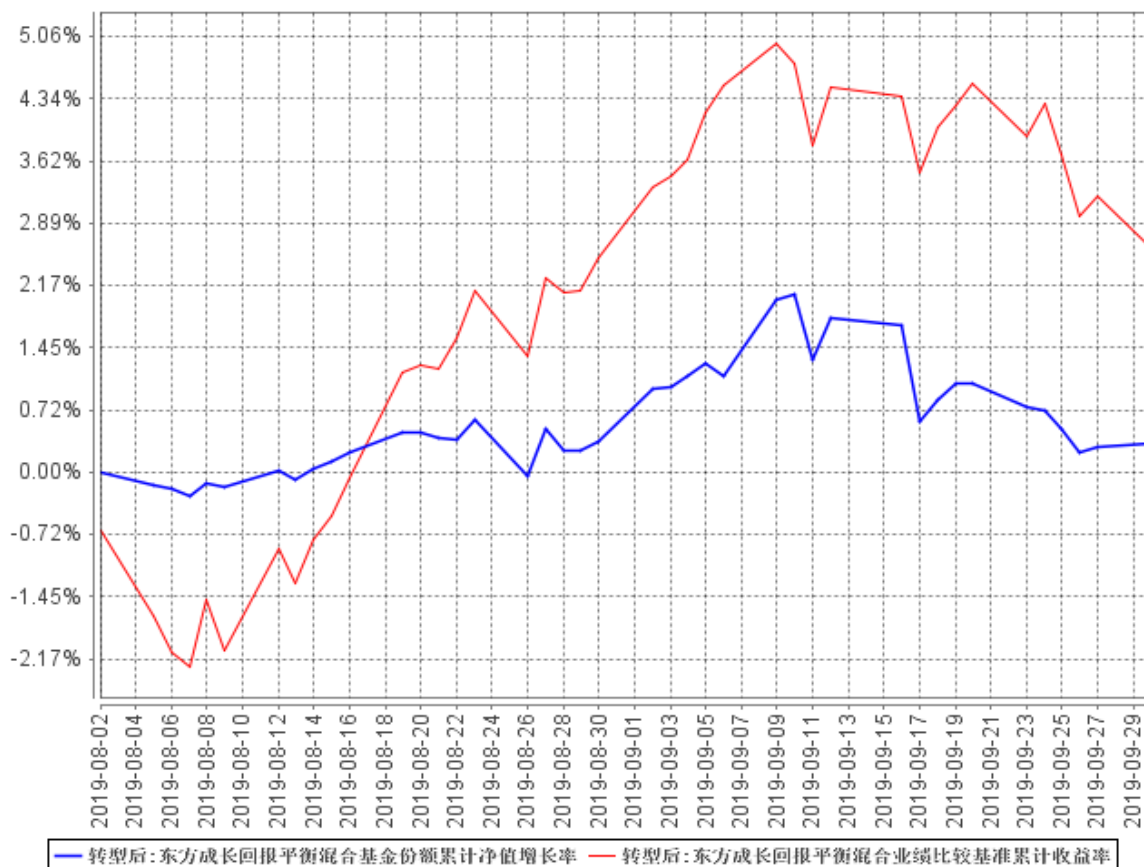
### 3.2 基金净值表现（转型后）

#### 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	0.33%	0.34%	2.59%	0.58%	-2.26%	-0.24%

### 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

东方成长回报平衡混合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 2019 年 8 月 2 日生效,截至报告期末,本基金成立不满六个月,仍处于建仓期。

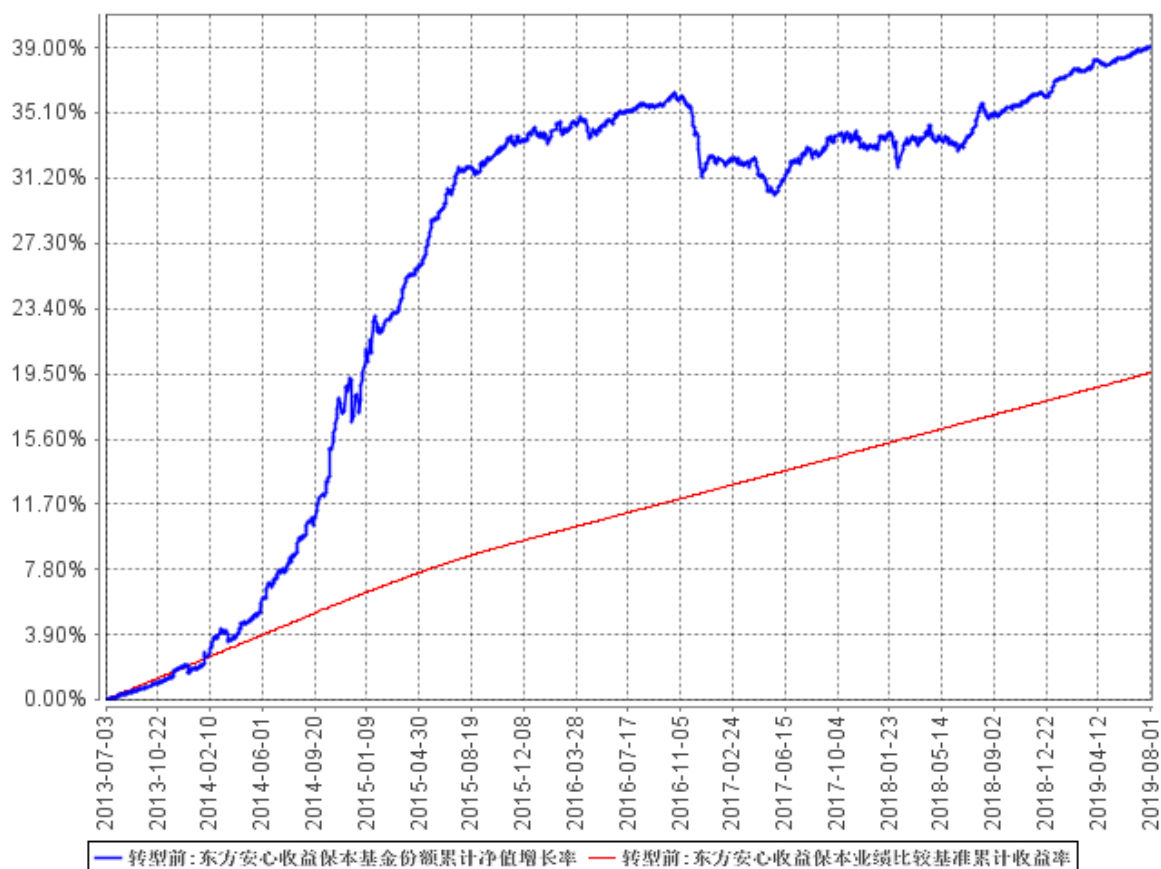
## 3.2 基金净值表现 (转型前)

### 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	0.19%	0.01%	0.26%	0.01%	-0.07%	0.00%

### 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

东方安心收益保本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（转型前）

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		
李瑞	本基金基金经理	2018年7月2日	-	8	中国人民大学金融学硕士，8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

					<p>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（于 2019 年 8 月 2 日起转型为东方成长回报平衡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。</p>
吴萍萍	<p>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</p>	<p>2016 年 3 月 21 日</p>	-	8	<p>固定收益投资部副总经理，投资决策委员会委员，中国人民大学应用经济学硕士，8 年证券从业经历，曾任安信证券投资组资金交易员、民生加银基金管理有限公司专户投资经理。2015 年 11 月加盟东方基金管理有限公司，曾任东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理助理、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理助理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方臻悦纯债债券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，现任东方安</p>

					心收益保本混合型证券投资基金（于 2019 年 8 月 2 日起转型为东方成长回报平衡混合型证券投资基金）基金经理、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方臻选纯债债券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、东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方臻享纯债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 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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		
李瑞	本基金基金经理	2019年8月2日	-	8	中国人民大学金融学硕士，8 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，东方安心收益保本混合型证券投资基金（于



					2019 年 8 月 2 日起转型为东方成长回报平衡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、东方成长回报平衡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。
吴萍萍	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	2019 年 8 月 2 日	-	8	固定收益投资部副总经理, 投资决策委员会委员, 中国人民大学应用经济学硕士, 8 年证券从业经历, 曾任安信证券投资组资金交易员、民生加银基金管理有限公司专户投资经理。2015 年 11 月加盟东方基金管理有限责任公司, 曾任东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理助理、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理助理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券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 (于 2019 年 8 月 2 日起转型为东方成长回报平衡混合型证券投资基金) 基金经理、东方臻悦纯债债券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，现任东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方臻选纯债债券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、东方永泰纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方臻享纯债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。

## 4.2 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、《东方成长回报平衡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

自上而下看，市场关注的焦点在经济下行压力、国内对冲政策等方面，而这些因素不确定性都很大。自下而上看，分化或分层是市场最大最确定的特点，一批具有宽厚的护城河、竞争优势突出、治理完善、财报优异的公司，无论内外部环境如何，都在不断创造价值并不断被越来越多的投资者认可。究其原因，市场的时代背景已经从总量波动为主变成了结构分化为主，大批优质公司走上了强者恒强的路。同时，投资者结构也正在发生机构化和国际化的深刻变化，正在发生质变，而这一趋势还在持续。

短期来看，市场仍然面临着经济下行、国内对冲政策等的干扰，但是市场的核心逻辑已经不是过去过度关注宏观、总量，从而追求贝塔，而更重要的是对优质公司的价值判断。

本基金坚持绝对收益投资理念，结构上看，优势企业与劣势企业之间的分化正在不断强化和扩大，落实到操作策略上就是坚持优质资产，这将是我们的最为看好并将一直坚持的投资策略。

从债券来看，进入 7 月尽管国内外经济下行压力加大，海外利率快速下行，但是国内债券收益率维持窄幅震荡，8 月初政治局会议召开、美联储降息靴子落地、国内长端利率出现快速下行，

打破市场僵局。8 月底受政金债监管变化传闻、10 年国开换券以及货币政策宽松预期落空等因素影响，收益率回调。债券收益率三季度先下后上，截至九月底，10 年期国债和 10 年期国开债分别为 3.1411%和 3.5338%较 7 月初分别下行 8BP 和 7BP。三季度转债市场走势好于股市，平均价格上涨 4.1%，转股溢价率的上升成为转债走强的主要助力。展望四季度货币政策稳定宽松预期不变，全球经济继续下行，海外债券市场处于下行通道，整体利好债市，9 月经济数据或小幅回调，叠加 CPI 年内继续走高或对债市形成一定扰动，预计四季度债券收益率呈波动态势。

具体投资策略方面，本基金灵活调整久期及仓位，在信用风险可控情况下，优选中高等级信用债以获取稳健的底仓收益，充分发掘单个券种超额收益机会，利率债方面择机参与利率债波段机会，并适度进行了转债波段操作以增厚组合收益，博取贝塔收益，获得了较好的投资回报。转债方面我们主要关注政策利好或基本面改善的行业，精选价格低、估值低的标的，严格控制仓位，稳重求进，博取收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2019 年 7 月 1 日起至 2019 年 8 月 1 日，转型前基金（东方安心收益保本混合型证券投资基金）净值增长率为 0.19%，业绩比较基准增长率为 0.26%，低于业绩比较基准 0.07%；2019 年 8 月 2 日起至 2019 年 9 月 30 日，转型后基金（东方成长回报平衡混合型证券投资基金）净值增长率为 0.33%，业绩比较基准增长率为 2.59%，低于业绩比较基准 2.26%。

#### 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

转型后：

#### 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	12,400,450.00	21.38
	其中：股票	12,400,450.00	21.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,116,000.00	34.68
	其中：债券	20,116,000.00	34.68
	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	25,058,029.94	43.19
8	其他资产	438,413.56	0.76
9	合计	58,012,893.50	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	1,092,000.00	1.93
C	制造业	8,611,350.00	15.24
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	-	-
J	金融业	2,263,600.00	4.01
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	433,500.00	0.77
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	12,400,450.00	21.95

## 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	600519	贵州茅台	1,300	1,495,000.00	2.65
2	002563	森马服饰	110,000	1,359,600.00	2.41
3	000895	双汇发展	50,000	1,235,000.00	2.19

4	600436	片仔癀	12,000	1,222,560.00	2.16
5	603993	洛阳钼业	300,000	1,092,000.00	1.93
6	603288	海天味业	9,000	989,190.00	1.75
7	601318	中国平安	10,000	870,400.00	1.54
8	000786	北新建材	40,000	720,000.00	1.27
9	601166	兴业银行	40,000	701,200.00	1.24
10	601288	农业银行	200,000	692,000.00	1.22

#### 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	20,116,000.00	35.60
	其中：政策性金融债	20,116,000.00	35.60
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,116,000.00	35.60

#### 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	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	170205	17 国开 05	200,000	20,116,000.00	35.60
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
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。

本基金所持有的兴业银行（601166）收到中国银行业监督管理委员会地方监管局对公司旗下昆明分行、宁波分行、信用卡中心、南宁分行、武汉分行、大连分行、广州分行、襄阳分行、烟台分行、兰州分行、上杭支行、龙岩分支行、济南分行、东营分行、威海分行、湖州分行、唐山分行、马鞍山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等。

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。

本基金投资兴业银行主要基于以下原因：公司是国内股份制银行龙头企业之一，业务结构稳健，业绩稳定，具备长期投资价值。

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	83,199.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	353,926.57
5	应收申购款	1,287.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	438,413.56

### 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。

转型前：

### 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	-	-



	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	369,610,366.39	99.96
8	其他资产	146,133.23	0.04
9	合计	369,756,499.62	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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、处罚的情形。

#### 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	41,906.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	104,227.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	146,133.23

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

## § 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2019年8月2日）基金份额总额	104,469,769.83
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	91,642.73
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	49,760,557.19

基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	54,800,855.37

## § 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	576,463,575.80
报告期期间基金总申购份额	105,466.13
减：报告期期间基金总赎回份额	472,099,272.10
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	104,469,769.83

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型后）

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（转型后）

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况（转型前）

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（转型前）

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 - 20190730	192,446,448.35	-	192,446,448.35	0.00	0.00%
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、《东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金合同》

- 二、《东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金托管协议》
- 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  
2019 年 10 月 23 日