

东方双债添利债券型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

2016 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年一月二十一日

§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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月 19 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 2016 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方双债添利债券
基金主代码	400027
交易代码	400027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 9 月 24 日
报告期末基金份额总额	106,802,857.95 份
投资目标	在适度承担信用风险并保持基金资产流动性的条件下，对固定收益类资产进行积极主动的投资管理，在此基础上通过个股精选配置权益类资产，实现基金资产长期、稳定的投资回报。
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。本基金紧密跟踪债券市场与股票市场的运行情况和风险收益特征，结合对宏观经济环境、国家政策趋向及利率变化趋势等重点分析，判断债券市场和股票市场的相对投资价值，在债券资产与股票资产之间进行动态调整。
业绩比较基准	本基金采用“中债综合全价指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%”作为投资业绩比较基准。
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	东方基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东方双债添利债券 A 类	东方双债添利债券 C 类
下属分级基金的交易代码	400027	400029
报告期末下属分级基金的份额总额	79,656,639.10 份	27,146,218.85 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（2016年10月1日—2016年12月31日）	
	东方双债添利债券 A 类	东方双债添利债券 C 类
1. 本期已实现收益	319,376.22	311,185.02
2. 本期利润	-1,584,436.04	-776,354.39
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0186	-0.0182
4. 期末基金资产净值	118,869,904.89	40,157,744.82
5. 期末基金份额净值	1.4923	1.4793

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

东方双债添利债券 A 类

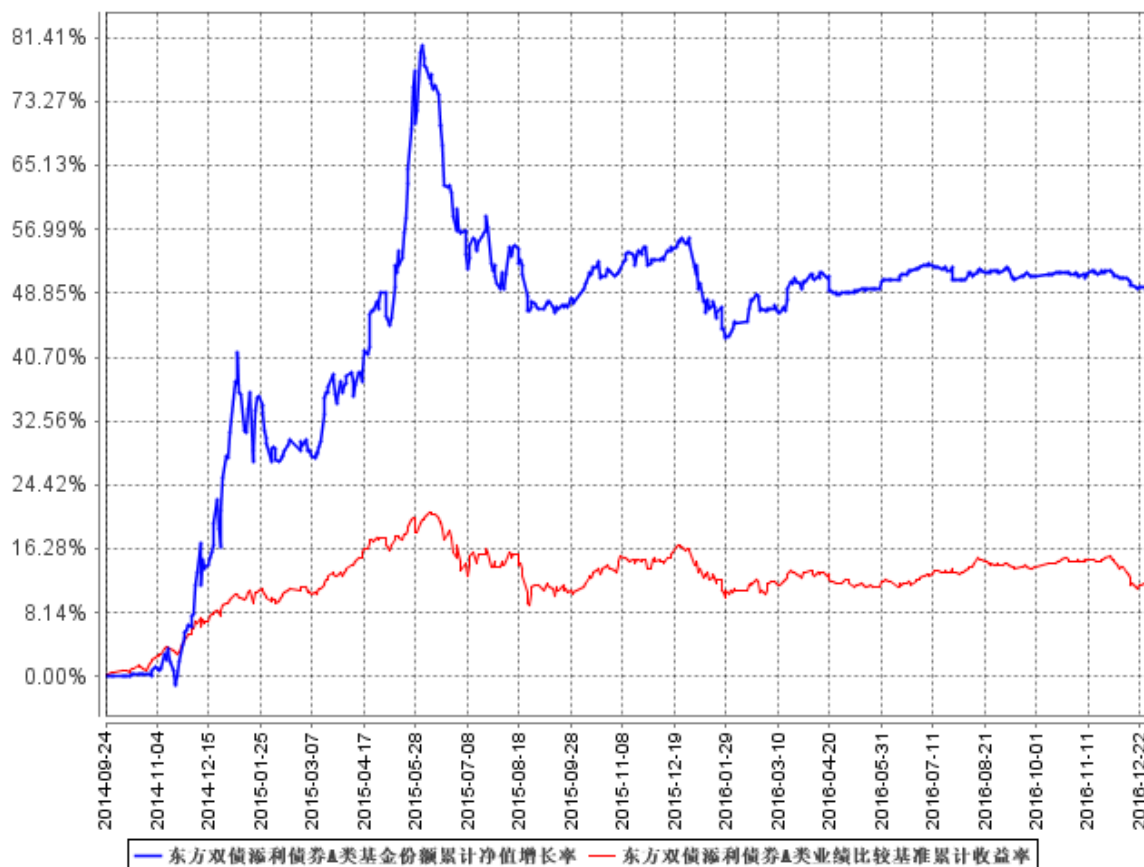
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.23%	0.12%	-1.49%	0.21%	0.26%	-0.09%

东方双债添利债券 C 类

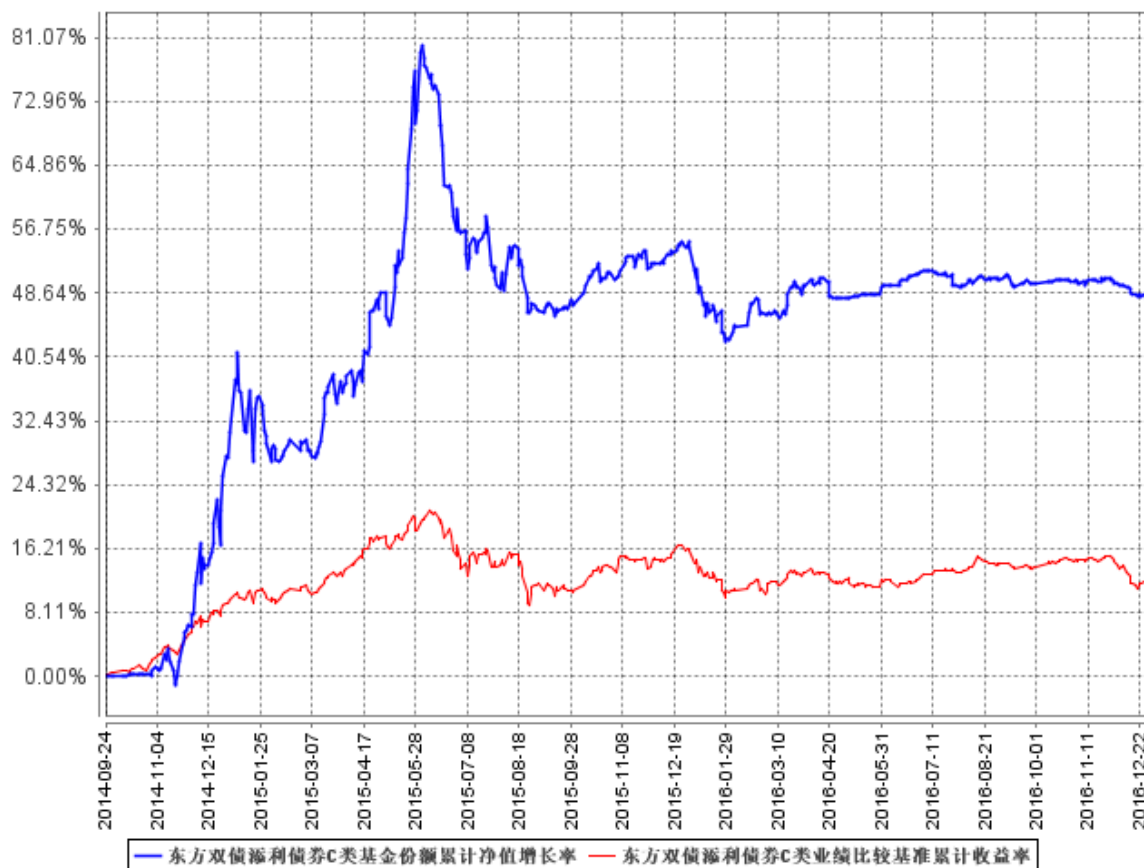
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.35%	0.12%	-1.49%	0.21%	0.14%	-0.09%

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

东方双债添利债券A类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



东方双债添利债券C类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		
徐昀君（先生）	本基金基金经理、固定收益部总经理助理、投资决策委员会委员	2014年9月24日	-	8年	对外经济贸易大学金融学硕士，CFA，FRM，8年证券从业经历。曾任安信证券资产管理部研究员、投资经理，华西证券资产管理部投资经理。2013年3月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理助理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方永

				<p>润 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。 现任固定收益部总经理助理，投资决策委员会委员，东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方强化收益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、东方双债添利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、东方利群混合型发起式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。</p>
李仆（先生）	<p>本基金基金经理、公司总经理助理、固定收益部总经理、投资决策委员会委员</p>	<p>2014 年 11 月 25 日</p>	-	<p>16 年</p> <p>16 年证券从业经历，曾任宝钢集团财务有限责任公司投资经理、宝钢集团有限公司投资经理、宝岛（香港）贸易有限公司投资部总经理、华宝信托有限责任公司资管部投资副总监、信诚基金管理有限公司基金经理。2014 年 2 月加盟东方基金管理有限责任公司，现任公司总经理助理、固定收益部总经理、投资决策委员会委员、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方稳定增利债券型证券投资基金基金经理、东方荣家保本混合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、东方臻馨债券型证券投资基金基金经理、东方永兴</p>

					18 个月定期开放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、《东方双债添利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《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

从基本面来看，2016 年四季度国内经济表现平稳，通胀中枢上移。具体而言，工业品价格反弹明显，带动工业企业利润大幅改善，以上游改善尤为明显，1-11 月工业企业利润累计同比 9.4%，原材料行业对利润增长的贡献率达到 67.9%；产出、投资稳中有升，11 月工业增加值同比 6.3%，1-11 月固定资产投资累计同比增速 8.3%，年底房地产、基建投资增速放缓；通胀温和回升，11 月 CPI 同比 2.3%，随着中上游价格持续上涨，PPI 到 CPI 的价格传递略有加快，生活资料的环比增速 0.2%，创 2013 年 2 月以来的新高，价格上涨更多是成本推动，而不是需求拉动。此外，海外市场方面，美国就业、通胀数据表现良好，特朗普提出的“基建、减税、贸易保护”等政策议题，大幅提升了全球风险偏好和通胀预期。

从政策面来看，2016 年 12 月中央经济工作会议弱化经济增长目标，推动供给侧改革，弱化地产投资属性，防范资产泡沫。货币政策方面，17 年货币政策被定调为稳健中性，再提“流动性闸门”，央行态度边际收紧；财政政策方面，将更加积极有效，预算安排要适应推进供给侧结构性改革、降低企业税费负担。

从资金面来看，2016 年四季度资金面波动较大，常处于紧平衡状态。具体来说，第一，受国庆长假、元旦跨年等季节性因素的影响；第二，外汇贬值环境下，基础货币流失较多，仅通过 MLF、OMO 等短期限工具对冲，银行需要持续抵押利率债，可能会存在可质押券不充足、LCR 指标分子缩水等问题；第三，12 月债市暴跌，货基、债基赎回规模较大，券商违约事件引发机构之间信任危机。随着央行供给流动性，银行间资金面有所缓解。

从债券市场来看，2016 年四季度债券市场波动较大，收益率大幅上行。10 月下旬，债券受广义理财可能纳入 MPA 考核以及资金面紧张的影响，收益率有所上行；11 月，债券市场继续调整，一方面资金面因素持续扰动，另一方面特朗普上台引发市场通胀预期，外盘债券收益率大幅度上行；12 月，债市迎来年内最大幅度下跌，中上旬央行对流动性支持不足，叠加货基、债基大规模赎回以及券商违约事件，市场出现踩踏，国债期货首现跌停，银行收紧对非银机构融资，市场进入暴跌、赎回、高估值甩券、货基负偏离的负反馈中，10 年国开 160210 最高曾飙涨超过 3.9%，下旬随着央行提供流动性、证监会协调券商违约事件，债市情绪暂稳定，止跌回调。

从权益市场来看，2016 年四季度维持震荡。10 月、11 月，特朗普当选美国总统、美联储加息预期提升等海外风险事件并未对 A 股带来剧烈影响，大盘蓝筹在供给侧改革和险资举牌的带动下有所反弹；12 月 A 股下跌，受险资举牌监管从严、部分万能险被叫停、货币环境边际收紧等

因素的影响，回落至 3100 点附近震荡。具体板块有所分化，建筑装饰、建筑材料、钢铁、商贸、化工等板块涨幅居前，计算机、传媒等板块跌幅居前。

报告期内，债券市场波动剧烈，虽然本基金组合久期偏短，但仍受影响，净值有小幅回撤。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2016 年 10 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日，本基金 A 类净值增长率为-1.23%，业绩比较基准收益率为-1.49%，高于业绩比较基准 0.26%；本基金 C 类净值增长率为-1.35%，业绩比较基准收益率为-1.49%，高于业绩比较基准 0.14%

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	29,399,543.42	12.86
	其中：股票	29,399,543.42	12.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	191,160,337.40	83.61
	其中：债券	191,160,337.40	83.61
	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	3,701,485.74	1.62
8	其他资产	4,380,034.14	1.92
9	合计	228,641,400.70	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	2,352,067.00	1.48
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,090,781.92	10.12

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,721,376.00	1.08
F	批发和零售业	3,750,073.50	2.36
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	3,673,068.00	2.31
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	1,812,177.00	1.14
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	29,399,543.42	18.49

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	300313	天山生物	123,793	2,352,067.00	1.48
2	300180	华峰超纤	92,650	2,269,925.00	1.43
3	300220	金运激光	76,200	2,215,896.00	1.39
4	300319	麦捷科技	55,800	2,192,382.00	1.38
5	300515	三德科技	40,692	2,086,685.76	1.31
6	300081	恒信移动	133,825	2,063,581.50	1.30
7	300258	精锻科技	137,100	2,009,886.00	1.26
8	300343	联创互联	81,120	1,938,768.00	1.22
9	300411	金盾股份	42,600	1,908,906.00	1.20
10	300008	天海防务	74,300	1,812,177.00	1.14

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	9,997,000.00	6.29
	其中：政策性金融债	9,997,000.00	6.29
4	企业债券	90,525,855.20	56.92
5	企业短期融资券	30,023,000.00	18.88
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	60,614,482.20	38.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	191,160,337.40	120.21

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	132001	14 宝钢 EB	126,260	14,293,894.60	8.99
2	1280191	12 旅顺建发债	200,000	12,438,000.00	7.82
3	122604	12 吉铁投	100,000	10,354,000.00	6.51
4	011698044	16 中建材 SCP006	100,000	10,018,000.00	6.30
5	071602007	16 国泰君安 CP007	100,000	10,008,000.00	6.29

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

2016 年 11 月 2 日，湘财证券股份有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）收到全国中

小企业股份转让系统出具的《关于对湘财证券股份有限公司采取约见谈话、提交书面承诺的自律监管措施决定的公告》（股转系统发【2016】329 号）。

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，由投资研究部负责，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策需经投资总监或投资决策委员会审批。

（4）交易执行：运营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 16 湘财 02 主要基于以下原因：

湘财证券有限责任公司创立于 1993 年 2 月 8 日，在中国各大主要城市设有 48 家营业网点。在 16 年的发展历程中，湘财证券创造了中国资本市场若干个“第一”：第一家获中国证监会批

准增资扩股；第一家被核准为全国综合性证券公司；第一批进入全国银行间同业拆借市场；第一家与国有商业银行签署股票质押协议；第一家获准设立中外合资证券公司；第一家向外资转让股权设立中外合资基金公司；成立中国第一家国家级证券博物馆。

16 湘财 02 的债项评级为 AA+，主体评级为 AA+，违约风险较低，还本付息确定性强。公司盈利能力较强，2015 年年报披露营业收入为 30.28 亿，同比增长 50.53%，营业利润为 16.36 亿，同比增长 56.83%。

国泰君安股份有限公司（以下简称“公司”）于 2016 年 12 月 27 日收到中国证券监督管理委员会《关于对国泰君安证券股份有限公司采取责令改正、增加内部合规检查次数并提交合规检查报告措施的事先告知书》（机构部函[2016]3280 号）。

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，由投资研究部负责，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策需经投资总监或投资决策委员会审批。

（4）交易执行：运营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 16 国泰君安 CP007 主要基于以下原因：

公司是在国泰证券和君安证券合并的基础上发起设立的股份有限公司，是国内历史最悠久、综合实力最强的证券公司之一。自成立以来，公司在资本实力、盈利水平和主营业务等方面持续保持在行业前列，并在长期发展过程中形成了较强的综合竞争力和品牌影响力。2008-2015 年，公司连续八年在证券公司分类评价中被评为 A 类 AA 级，为目前证券公司获得的最高评级。公司直接拥有 6 家境内子公司和 1 家境外子公司，公司在全国 29 个省、市、自治区设有 30 家分公司和 243 家证券营业部，公司全资子公司国泰君安期货公司在全国设有 12 家期货营业部；公司控股子公司上海证券在全国设有 1 家分公司和 56 家证券营业部，其全资子公司海证期货在全国设有 4 家期货营业部。

16 国泰君安 CP007 的债项评级为 A-1，主体评级为 AAA，违约风险较低。且本债券的到期日为 2017 年 1 月 12 日，剩余期限较短，还本付息确定性强。公司盈利能力较强，2015 年年报披露营业收入为 375.97 亿，同比增长 110.25%，营业利润为 217.30 亿，同比增长 136.72%。

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

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	125,405.26
2	应收证券清算款	1,988,500.83
3	应收股利	-
4	应收利息	2,265,720.58
5	应收申购款	407.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,380,034.14

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	113009	广汽转债	6,841,790.40	4.30
2	110035	白云转债	6,716,275.20	4.22
3	128012	辉丰转债	4,599,376.00	2.89
4	110030	格力转债	4,552,800.00	2.86
5	110032	三一转债	4,094,766.00	2.57
6	110031	航信转债	3,583,140.00	2.25
7	110033	国贸转债	3,552,600.00	2.23
8	123001	蓝标转债	377,223.70	0.24

5.10.5 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	300450	先导智能	1,019.70	0.00	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东方双债添利债券 A 类	东方双债添利债券 C 类
报告期期初基金份额总额	87,180,126.58	46,758,599.86
报告期期间基金总申购份额	66,342,191.65	90,706.90
减:报告期期间基金总赎回份额	73,865,679.13	19,703,087.91
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	79,656,639.10	27,146,218.85

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 一、《东方双债添利债券型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方双债添利债券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

8.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人办公场所。

8.3 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
2017 年 1 月 21 日