

# 东方可转债债券型证券投资基金

## 2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 4 月 22 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 4 月 21 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	东方可转债债券	
基金主代码	009465	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 3 月 4 日	
报告期末基金份额总额	306,866,252.86 份	
投资目标	在严格控制风险的前提下，通过对可转债的积极投资，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金的主要投资策略包括：大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略（1. 可转换债券和可交换债券投资策略；2. 普通债券投资策略；3. 资产支持证券投资策略）、权益类资产投资策略、国债期货的投资策略等。	
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×70%+中债综合指数收益率×30%	
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	东方基金管理股份有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东方可转债债券 A	东方可转债债券 C
下属分级基金的交易代码	009465	009466
报告期末下属分级基金的份额总额	91,744,313.33 份	215,121,939.53 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（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日）	
	东方可转债债券 A	东方可转债债券 C
1. 本期已实现收益	-1,617,803.09	-8,690,275.70
2. 本期利润	2,747,113.58	15,563,780.69
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0509	0.0536
4. 期末基金资产净值	97,401,387.86	227,565,413.42
5. 期末基金份额净值	1.0617	1.0578

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

东方可转债债券 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	5.48%	0.67%	2.55%	0.26%	2.93%	0.41%
过去六个月	1.09%	0.72%	0.60%	0.33%	0.49%	0.39%
过去一年	2.25%	0.76%	1.43%	0.35%	0.82%	0.41%
自基金合同生效起至今	10.73%	0.71%	7.83%	0.40%	2.90%	0.31%

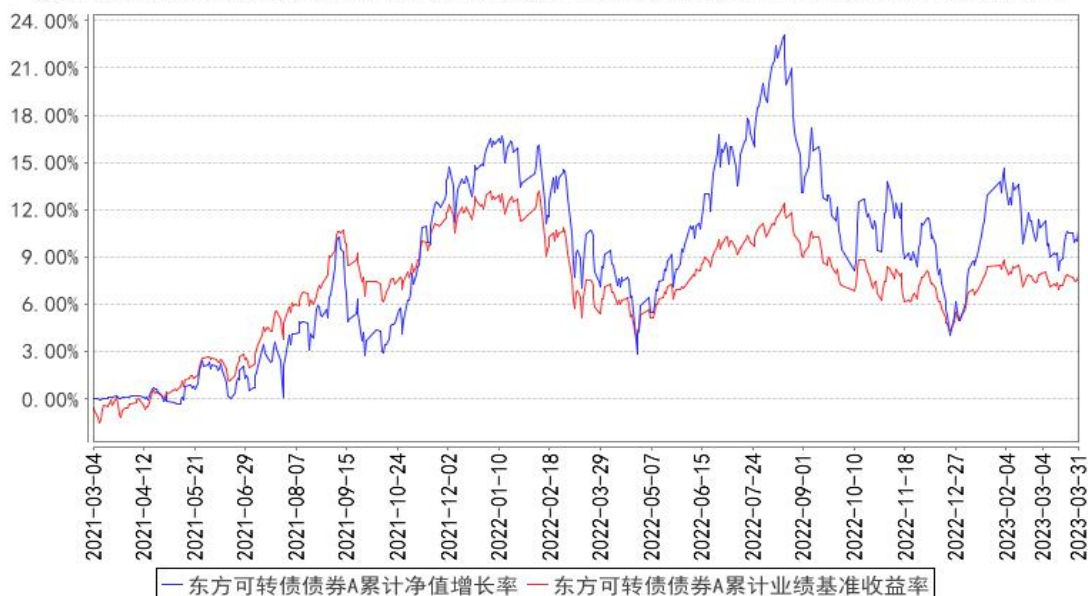
东方可转债债券 C

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	5.37%	0.67%	2.55%	0.26%	2.82%	0.41%
过去六个月	0.88%	0.72%	0.60%	0.33%	0.28%	0.39%
过去一年	1.84%	0.76%	1.43%	0.35%	0.41%	0.41%

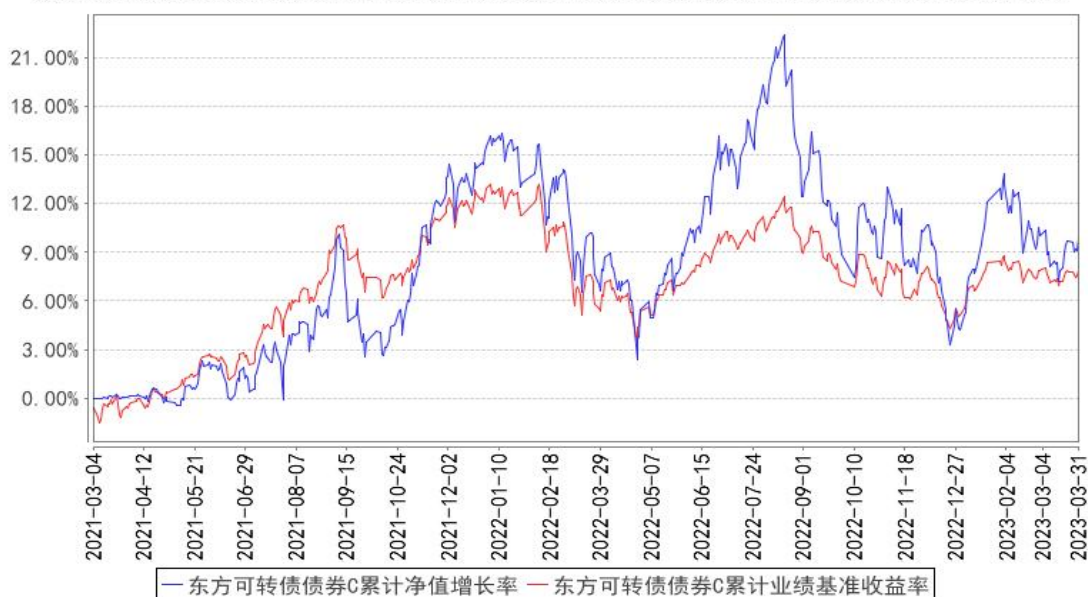
自基金合同生效起至今	9.82%	0.71%	7.83%	0.40%	1.99%	0.31%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

### 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

东方可转债债券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



东方可转债债券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



## §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 3 月 4 日	-	18 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，18 年证券从业经历。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。
徐奥千	本基金基金经理	2022 年 1 月 4 日	-	7 年	维多利亚大学经济专业硕士，7 年证券从业经历。曾任神雾集团证券专员。2017 年加盟本基金管理人，曾任固定收益研究部研究员、交易部债券交易员，东方双债添利债券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、东方可转债债券型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助理，现任东方可转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。

#### 4.1.1 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、《东方可转债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

2023 年 1 季度，外围局势逐渐稳定，俄乌冲突陷入胶着。国内两会顺利召开，部委换届延续宽松政策，后疫情时代经济弱势复苏进行中。经历了 2022 年多重利空反复冲击之后，市场整体处于低位，投资人开始对利空逐渐钝化，风险偏好有所上升。受此影响，1 季度市场整体回暖，股市表现较好，债市表现也好于预期。

本基金操作方面，我们延续了 2022 年底的投资策略，对于 2023 年抱有较好预期，认为在人口老龄化加剧下经济复苏或会比较孱弱，实体经济可能较慢回暖，在经济数据出现明显回暖迹象之前，无论货币还是财政，政策环境有望保持友好，因此对股票市场相对乐观。具体操作上，保持了 13% 左右的较高股票，并适度进行行业集中。减持了周期类股票和部分军工股票，增持了中药、TMT、电子和先进制造等科技板块。可转债方面，我们减持了部分双低转债，增加了可转债组

合的弹性，整体仓位稳定。净值表现来看，1 季度业绩基本达到年初预期。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 03 月 31 日,本基金 A 类净值增长率为 5.48%，业绩比较基准收益率为 2.55%，高于业绩比较基准 2.93%；本基金 C 类净值增长率为 5.37%，业绩比较基准收益率为 2.55%，高于业绩比较基准 2.82%。

#### 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	44,021,550.00	10.92
	其中：股票	44,021,550.00	10.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	347,080,243.41	86.12
	其中：债券	347,080,243.41	86.12
	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	11,819,934.35	2.93
8	其他资产	116,951.39	0.03
9	合计	403,038,679.15	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	30,963,680.00	9.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	661,200.00	0.20
F	批发和零售业	393,890.00	0.12
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	10,400,380.00	3.20
J	金融业	1,602,400.00	0.49
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	-	-
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	44,021,550.00	13.55

### 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	688041	海光信息	38,000	2,932,460.00	0.90
2	300181	佐力药业	160,000	2,390,400.00	0.74
3	603893	瑞芯微	26,000	2,340,780.00	0.72
4	600941	中国移动	24,000	2,159,280.00	0.66
5	301030	仕净科技	45,000	1,973,250.00	0.61
6	300059	东方财富	80,000	1,602,400.00	0.49
7	301129	瑞纳智能	20,000	1,599,000.00	0.49
8	002439	启明星辰	40,000	1,330,000.00	0.41
9	002371	北方华创	5,000	1,329,250.00	0.41
10	688120	华海清科	4,000	1,267,200.00	0.39

### 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	13,903,220.63	4.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,094,393.97	0.95
	其中：政策性金融债	3,094,393.97	0.95
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）	330,082,628.81	101.57
8	同业存单	-	-



9	其他	-	-
10	合计	347,080,243.41	106.80

### 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	110061	川投转债	82,000	12,532,352.05	3.86
2	113044	大秦转债	100,000	11,291,671.23	3.47
3	127056	中特转债	92,000	10,331,663.01	3.18
4	113057	中银转债	80,000	9,673,361.10	2.98
5	110062	烽火转债	74,940	8,993,138.77	2.77

### 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

本基金所持有川投转债（110061），发行人四川川投能源股份有限公司（以下简称“公司”）。控股股东四川省投资集团有限责任公司董事长刘体斌因未依法履行其他职责，已被四川省监察委员会立案调查及实施留置措施。公司目前经营一切正常，该事项不会对正常经营造成影响。

本基金所持有瑞芯微（603893），发行人瑞芯微电子股份有限公司（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。

本基金所持有东方财富（300059），发行人东方财富证券股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责，被中国证券监督管理委员会责令改正。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。

本基金投资川投转债主要基于以下原因：

水电龙头企业，长期现金流和分红稳定，看好公司随时间增长而增长的优质公用事业属性。

本基金投资瑞芯微主要基于以下原因：

公司聚焦于 AIOT 领域，在人工智能爆发的大背景下，终端 AI 芯片的国产替代需求有望快速上升。

本基金投资东方财富主要基于以下原因：

公司护城河深，在过程较长时间证明了自己行业龙头地位，看好公司能长期维持互联网券商龙头地位。

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	53,208.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	63,742.92
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	116,951.39

### 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	110061	川投转债	12,532,352.05	3.86
2	113044	大秦转债	11,291,671.23	3.47
3	127056	中特转债	10,331,663.01	3.18
4	113057	中银转债	9,673,361.10	2.98
5	110062	烽火转债	8,993,138.77	2.77
6	118020	芳源转债	8,911,366.44	2.74
7	118018	瑞科转债	8,687,662.00	2.67
8	123025	精测转债	8,357,210.14	2.57
9	127066	科利转债	8,348,693.75	2.57
10	123107	温氏转债	8,342,527.40	2.57
11	113053	隆 22 转债	8,097,977.81	2.49
12	118014	高测转债	7,131,991.48	2.19
13	127036	三花转债	6,815,729.51	2.10
14	118015	芯海转债	6,617,139.62	2.04
15	113632	鹤 21 转债	6,596,271.10	2.03
16	113639	华正转债	6,562,923.21	2.02
17	110057	现代转债	6,389,500.00	1.97
18	110088	淮 22 转债	5,772,827.18	1.78

19	127050	麒麟转债	5,711,398.90	1.76
20	118008	海优转债	5,639,849.53	1.74
21	123119	康泰转 2	5,557,721.92	1.71
22	113641	华友转债	5,497,034.96	1.69
23	123144	裕兴转债	5,386,654.11	1.66
24	127054	双箭转债	5,237,042.74	1.61
25	123075	贝斯转债	5,136,429.45	1.58
26	123145	药石转债	5,129,100.27	1.58
27	113629	泉峰转债	4,947,606.79	1.52
28	123099	普利转债	4,904,583.56	1.51
29	123104	卫宁转债	4,606,172.60	1.42
30	110083	苏租转债	4,285,142.96	1.32
31	110086	精工转债	4,150,662.90	1.28
32	128122	兴森转债	4,137,369.86	1.27
33	127052	西子转债	4,022,791.51	1.24
34	113621	彤程转债	3,970,030.34	1.22
35	113619	世运转债	3,967,859.73	1.22
36	127073	天赐转债	3,888,797.81	1.20
37	113643	风语转债	3,850,214.79	1.18
38	127058	科伦转债	3,478,045.48	1.07
39	113638	台 21 转债	3,253,653.70	1.00
40	123158	宙邦转债	3,185,568.05	0.98
41	113644	艾迪转债	3,134,451.45	0.96
42	113060	浙 22 转债	3,054,439.04	0.94
43	123088	威唐转债	2,679,411.34	0.82
44	123120	隆华转债	2,582,517.81	0.79
45	113048	晶科转债	2,203,126.03	0.68
46	123150	九强转债	2,191,213.15	0.67
47	113049	长汽转债	2,112,815.34	0.65
48	113061	拓普转债	2,110,950.58	0.65
49	118017	深科转债	1,975,577.67	0.61
50	110089	兴发转债	1,633,852.16	0.50
51	113658	密卫转债	1,473,474.41	0.45
52	123077	汉得转债	1,298,724.66	0.40
53	123157	科蓝转债	1,295,007.12	0.40
54	110053	苏银转债	1,284,864.86	0.40
55	113585	寿仙转债	991,715.07	0.31
56	128101	联创转债	913,518.22	0.28
57	118003	华兴转债	862,888.77	0.27
58	123122	富瀚转债	861,285.75	0.27
59	127072	博实转债	837,093.53	0.26
60	113615	金诚转债	833,960.96	0.26

61	127063	贵轮转债	763,837.15	0.24
62	127049	希望转 2	579,757.53	0.18
63	123154	火星转债	515,348.60	0.16
64	113653	永 22 转债	496,266.19	0.15
65	113636	甬金转债	479,877.81	0.15
66	127043	川恒转债	430,545.29	0.13
67	128140	润建转债	406,603.90	0.13
68	113634	珀莱转债	297,109.86	0.09
69	113602	景 20 转债	259,858.60	0.08
70	111004	明新转债	258,445.26	0.08
71	111006	嵘泰转债	254,346.41	0.08
72	123133	佩蒂转债	251,883.01	0.08
73	118013	道通转债	127,195.56	0.04

### 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	东方可转债债券 A	东方可转债债券 C
报告期期初基金份额总额	52,295,996.75	299,139,022.59
报告期期间基金总申购份额	59,163,346.28	95,127,518.20
减:报告期期间基金总赎回份额	19,715,029.70	179,144,601.26
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	91,744,313.33	215,121,939.53

## §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	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	期初	申购	赎回	持有份额	份额占比(%)

者类别		份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	份额	份额	份额		
产 品	1	20230101 - 20230130	78,597,957.52		-47,500,000.00	31,097,957.52	10.13
	2	20230214 - 20230323	78,597,957.52		-47,500,000.00	31,097,957.52	10.13
	3	20230131 - 20230331		-91,945,568.22		-91,945,568.22	29.96
产品特有风险							
<p>基金管理人对本基金拥有完全自主投资决策权。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>							

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 一、《东方可转债债券型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方可转债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

2023 年 4 月 22 日