

东方双债添利债券型证券投资基金

2024 年第 4 季度报告

2024 年 12 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 1 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 1 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 2024 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		
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	403,614,427.85 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 and 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	中债综合全价指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%		
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	东方双债添利债券 C	东方双债添利债券 D

下属分级基金的交易代码	400027	400029	019095
报告期末下属分级基金的份额总额	401,524,101.59 份	2,052,328.45 份	37,997.81 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（2024 年 10 月 1 日-2024 年 12 月 31 日）		
	东方双债添利债券 A	东方双债添利债券 C	东方双债添利债券 D
1. 本期已实现收益	38,320,924.62	209,818.87	2,221.95
2. 本期利润	16,724,152.26	67,004.86	1,339.11
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0321	0.0242	0.0377
4. 期末基金资产净值	467,969,222.64	2,365,653.69	44,291.57
5. 期末基金份额净值	1.1655	1.1527	1.1656

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

东方双债添利债券 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	2.54%	1.27%	1.51%	0.34%	1.03%	0.93%
过去六个月	3.39%	1.07%	4.94%	0.31%	-1.55%	0.76%
过去一年	-0.05%	0.93%	7.24%	0.25%	-7.29%	0.68%
过去三年	-9.78%	0.69%	2.23%	0.23%	-12.01%	0.46%
过去五年	10.34%	0.62%	8.60%	0.24%	1.74%	0.38%
自基金合同生效起至今	75.68%	0.64%	30.81%	0.28%	44.87%	0.36%

东方双债添利债券 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	2.43%	1.27%	1.51%	0.34%	0.92%	0.93%
过去六个月	3.19%	1.07%	4.94%	0.31%	-1.75%	0.76%
过去一年	-0.45%	0.93%	7.24%	0.25%	-7.69%	0.68%
过去三年	-10.91%	0.69%	2.23%	0.23%	-13.14%	0.46%
过去五年	8.09%	0.62%	8.60%	0.24%	-0.51%	0.38%
自基金合同生效起至今	68.81%	0.64%	30.81%	0.28%	38.00%	0.36%

东方双债添利债券 D

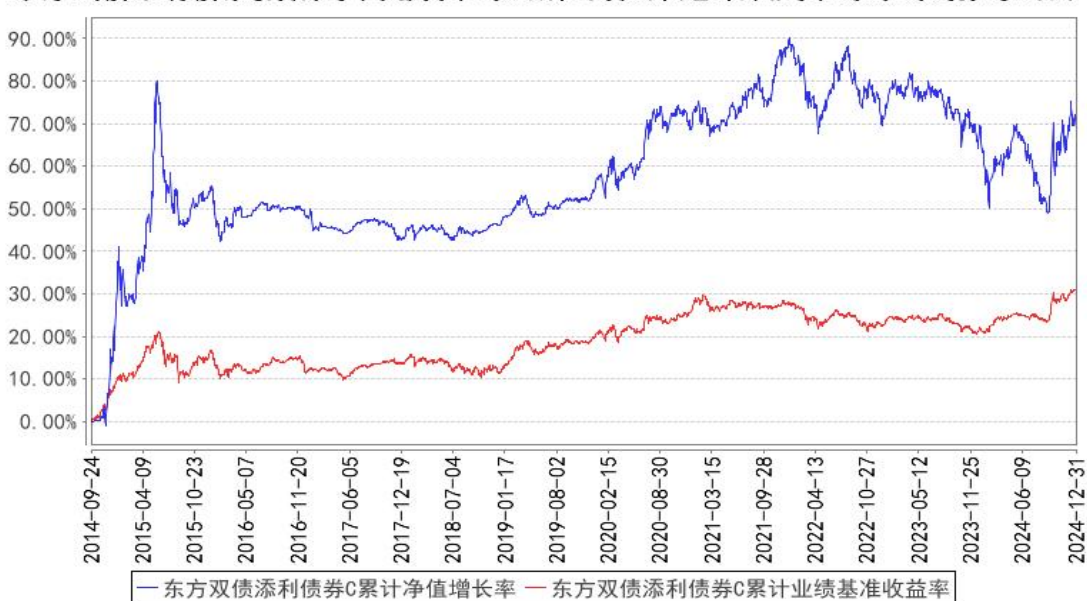
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.54%	1.27%	1.51%	0.34%	1.03%	0.93%
过去六个月	3.39%	1.07%	4.94%	0.31%	-1.55%	0.76%
过去一年	-0.05%	0.93%	7.24%	0.25%	-7.29%	0.68%
自基金合同生效起至今	-1.65%	0.86%	5.80%	0.23%	-7.45%	0.63%

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D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	2019年11月14日	-	19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，19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，东方多策略灵活配置混合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，现任东方双债添利债券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。

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》

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中的公平交易程序；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

2024 年四季度，外围经济整体较为平稳，美国经济增长韧性较强，通胀有所回落但跌势趋缓，欧洲经济较弱，日本经济继续走强。政策方面，美联储四季度继续降息，但随着特朗普胜选，降

息预期减弱，美元指数走势转强，中美利差扩大后对人民币汇率带来扰动。

国内来看，924 新政对经济较弱走势并未构成即刻影响。政策方面，化债等扩张性政策在四季度开始逐渐落地，对经济的托举作用还有待时间验证。较为有利的是政策管理层支持经济和资本市场的态度明确，对于缓解市场风险偏好具有较好作用。

在此背景下，股市交易情绪有所提升，股市一度较为强劲，上证指数在创下两年多新高后进入宽幅震荡格局。债市最初调整后再次强劲上涨，十年期国债收益率不断下行创历史记录，债市走出了第四年较好的行情。

本基金操作方面，四季度维持了较高权益仓位，组合基本跑平市场净值收复失地，但最后两日意外的股市大幅调整仍使得基金净值年度微跌，非常遗憾。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2024 年 10 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 日，本基金 A 类净值增长率为 2.54%，业绩比较基准收益率为 1.51%，高于业绩比较基准 1.03%；本基金 C 类净值增长率为 2.43%，业绩比较基准收益率为 1.51%，高于业绩比较基准 0.92%；本基金 D 类净值增长率为 2.54%，业绩比较基准收益率为 1.51%，高于业绩比较基准 1.03%。

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	84,185,193.88	16.14
	其中：股票	84,185,193.88	16.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	421,075,746.16	80.72
	其中：债券	421,075,746.16	80.72
	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	8,200,000.00	1.57
	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	6,901,560.13	1.32

8	其他资产	1,289,617.57	0.25
9	合计	521,652,117.74	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	947,672.00	0.20
C	制造业	47,041,033.48	10.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,042,136.00	1.07
E	建筑业	2,831,792.00	0.60
F	批发和零售业	5,507,610.00	1.17
G	交通运输、仓储和邮政业	972,360.00	0.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,583,660.00	2.89
J	金融业	3,108,434.00	0.66
K	房地产业	1,094,948.40	0.23
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	254,648.00	0.05
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	3,800,900.00	0.81
S	综合	-	-
	合计	84,185,193.88	17.90

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

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	002558	巨人网络	290,000	3,680,100.00	0.78
2	000034	神州数码	100,000	3,505,000.00	0.75
3	002138	顺络电子	110,000	3,462,800.00	0.74
4	002517	恺英网络	250,000	3,402,500.00	0.72
5	300602	飞荣达	165,400	3,178,988.00	0.68
6	300002	神州泰岳	250,000	2,897,500.00	0.62

7	002698	博实股份	150,000	2,550,000.00	0.54
8	603296	华勤技术	35,000	2,483,250.00	0.53
9	688190	云路股份	24,000	2,208,000.00	0.47
10	300251	光线传媒	230,000	2,171,200.00	0.46

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	25,351,304.03	5.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,433,167.12	4.34
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	12,331,551.12	2.62
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,394,562.74	2.21
7	可转债（可交换债）	352,565,161.15	74.95
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	421,075,746.16	89.52

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	185359	22 海通 02	200,000	20,433,167.12	4.34
2	019740	24 国债 09	158,000	15,999,616.77	3.40
3	127037	银轮转债	73,009	13,605,507.18	2.89
4	127087	星帅转 2	91,005	11,673,236.28	2.48
5	118014	高测转债	108,000	11,135,104.77	2.37

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

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

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 22 海通 02 (185359.SH)，发行人海通证券股份有限公司（以下简称“公司”），受到处罚。公司因未依法履行职责、定期报告披露违规等原因，被中国证券监督管理委员会、中国人民银行、深圳证券交易所、上海证券交易所公开处罚。公司目前经营情况正常，上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金所持有星帅转 2 (127087.SZ)，发行人杭州星帅尔电器股份有限公司（以下简称“公司”），受到处罚。公司因未依法履行职责、特定重大事项披露违规等原因，被中国证券监督管理委员会、深圳证券交易所、浙江证监局公开处罚。公司目前经营情况正常，本次监管措施不会影响公司正常的生产经营活动。

本基金所持有杭银转债 (110079.SH)，发行人杭州银行股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因未依法履行职责，被国家外汇管理局、国家金融监督管理总局公开处罚。本次监管措施不会影响公司正常的经营管理活动。

本基金所持有台 21 转债 (113638.SH)，发行人浙江台华新材料集团股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因未依法履行职责，被上海证券交易所出具监管工作函，本次监管措施不会影响公司正常的经营管理活动。

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，由固定收益研究部负责，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。

本基金所持 22 海通 02 (185359.SH) 基于以下原因：

公司作为国内头部券商之一，总体资本实力强，业务覆盖范围广，多项经营指标位于行业靠前水平，信用风险较低，具备投资价值。

本基金投资杭银转债 (110079.SH) 基于以下原因：

公司在城商行中依旧保持了较快的业绩增速同时因为所在区域优势也拥有极佳的资产质量，相对目前较低的估值，公司未来有估值提升的空间。

本基金投资星帅转 2 (127087.SZ) 基于以下原因：

公司是制冷压缩机零部件龙头，公司现有白色家电业务市场占有率较高，客户粘性强。光伏组件业务是第二成长曲线，该业务市场格局有望进一步优化。

本基金投资台 21 转债 (113638.SH) 基于以下原因：

公司主要产品属于高端体育用品材料，目前下游对应品牌销售情况良好，除此外公司也有相对明确的产能扩张计划。

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	226,142.98
2	应收证券清算款	1,063,044.60
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	429.99
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,289,617.57

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	127037	银轮转债	13,605,507.18	2.89
2	127087	星帅转 2	11,673,236.28	2.48
3	118014	高测转债	11,135,104.77	2.37
4	111008	沿浦转债	10,952,063.70	2.33
5	128137	洁美转债	10,806,681.45	2.30
6	110079	杭银转债	10,327,294.25	2.20
7	113638	台 21 转债	10,047,197.81	2.14
8	127041	弘亚转债	8,375,413.70	1.78
9	127090	兴瑞转债	8,057,602.85	1.71
10	113062	常银转债	8,042,604.71	1.71
11	127031	洋丰转债	6,295,691.78	1.34
12	123127	耐普转债	6,225,254.74	1.32
13	110093	神马转债	6,138,346.41	1.30
14	123163	金沃转债	5,811,122.88	1.24
15	111003	聚合转债	5,678,439.04	1.21
16	123223	九典转 02	5,647,422.07	1.20
17	113639	华正转债	5,402,487.67	1.15
18	123182	广联转债	5,199,230.14	1.11
19	111011	冠盛转债	5,056,583.89	1.08
20	123169	正海转债	5,028,172.29	1.07
21	123121	帝尔转债	5,014,374.25	1.07
22	123212	立中转债	4,998,098.63	1.06
23	118007	山石转债	4,699,362.74	1.00

24	123091	长海转债	4,683,651.29	1.00
25	127098	欧晶转债	4,314,532.60	0.92
26	127093	章鼓转债	4,295,732.27	0.91
27	113666	爱玛转债	4,172,583.29	0.89
28	127105	龙星转债	4,168,310.79	0.89
29	123172	漱玉转债	3,905,904.11	0.83
30	127072	博实转债	3,762,407.99	0.80
31	127032	苏行转债	3,532,624.52	0.75
32	113628	晨丰转债	3,378,127.40	0.72
33	110062	烽火转债	3,216,122.19	0.68
34	111002	特纸转债	3,170,850.41	0.67
35	123088	威唐转债	3,144,735.62	0.67
36	127104	姚记转债	3,058,948.60	0.65
37	123063	大禹转债	3,041,019.62	0.65
38	113676	荣 23 转债	2,927,021.59	0.62
39	118028	会通转债	2,773,253.70	0.59
40	127079	华亚转债	2,766,121.64	0.59
41	123152	润禾转债	2,735,068.19	0.58
42	123207	冠中转债	2,609,334.52	0.55
43	118016	京源转债	2,583,414.38	0.55
44	123198	金埔转债	2,518,608.82	0.54
45	123229	艾录转债	2,509,140.82	0.53
46	123129	锦鸡转债	2,421,661.75	0.51
47	123201	纽泰转债	2,408,168.77	0.51
48	123076	强力转债	2,401,969.86	0.51
49	123184	天阳转债	2,399,106.06	0.51
50	123220	易瑞转债	2,223,935.42	0.47
51	123230	金钟转债	2,110,454.55	0.45
52	128066	亚泰转债	2,096,514.25	0.45
53	123234	中能转债	2,048,472.99	0.44
54	123059	银信转债	1,979,919.59	0.42
55	127081	中旗转债	1,966,130.41	0.42
56	113669	景 23 转债	1,964,671.23	0.42
57	123225	翔丰转债	1,941,389.86	0.41
58	123147	中辰转债	1,906,454.79	0.41
59	123159	崧盛转债	1,896,526.99	0.40
60	111016	神通转债	1,881,764.38	0.40
61	123194	百洋转债	1,873,654.67	0.40
62	123141	宏丰转债	1,789,500.00	0.38
63	118015	芯海转债	1,767,221.48	0.38
64	113640	苏利转债	1,732,786.85	0.37
65	113674	华设转债	1,703,096.16	0.36

66	123189	晓鸣转债	1,679,862.97	0.36
67	123160	泰福转债	1,634,618.63	0.35
68	118041	星球转债	1,631,695.18	0.35
69	123056	雪榕转债	1,614,998.63	0.34
70	118037	上声转债	1,417,307.81	0.30
71	113654	永 02 转债	1,332,945.21	0.28
72	113532	海环转债	1,300,317.60	0.28
73	128070	智能转债	1,230,132.88	0.26
74	123221	力诺转债	1,220,635.62	0.26
75	123224	宇邦转债	1,203,011.78	0.26
76	113664	大元转债	1,197,091.78	0.25
77	123180	浙矿转债	1,167,120.79	0.25
78	118010	洁特转债	1,149,388.49	0.24
79	123022	长信转债	1,142,971.64	0.24
80	113068	金铜转债	1,140,576.44	0.24
81	123156	博汇转债	1,134,272.55	0.24
82	123171	共同转债	1,127,191.70	0.24
83	118009	华锐转债	1,099,586.30	0.23
84	113646	永吉转债	1,081,553.97	0.23
85	127094	红墙转债	1,080,021.92	0.23
86	118030	睿创转债	1,054,835.07	0.22
87	127068	顺博转债	1,003,012.33	0.21
88	128076	金轮转债	973,570.41	0.21
89	123122	富瀚转债	917,332.60	0.20
90	113039	嘉泽转债	863,470.14	0.18
91	123236	家联转债	800,106.71	0.17
92	123185	能辉转债	798,573.81	0.17
93	123146	中环转 2	795,312.19	0.17
94	123204	金丹转债	771,124.77	0.16
95	127075	百川转 2	768,265.34	0.16
96	113663	新化转债	768,147.12	0.16
97	123175	百畅转债	755,144.11	0.16
98	118029	富淼转债	749,226.49	0.16
99	113680	丽岛转债	743,478.44	0.16
100	123093	金陵转债	738,009.86	0.16
101	123131	奥飞转债	734,022.05	0.16
102	123126	瑞丰转债	714,138.08	0.15
103	118012	微芯转债	683,420.55	0.15
104	113681	镇洋转债	654,795.78	0.14
105	123067	斯莱转债	651,004.11	0.14
106	127053	豪美转债	644,197.95	0.14
107	123166	蒙泰转债	634,739.04	0.13

108	128124	科华转债	628,236.99	0.13
109	127019	国城转债	626,178.77	0.13
110	127077	华宏转债	619,474.52	0.13
111	123190	道氏转 02	611,673.97	0.13
112	127060	湘佳转债	603,423.78	0.13
113	123173	恒锋转债	597,021.92	0.13
114	123237	佳禾转债	596,194.74	0.13
115	128120	联诚转债	592,600.41	0.13
116	111019	宏柏转债	578,467.67	0.12
117	113033	利群转债	572,324.66	0.12
118	127088	赫达转债	569,047.26	0.12
119	128105	长集转债	560,866.85	0.12
120	113648	巨星转债	530,400.68	0.11
121	113608	威派转债	517,764.58	0.11
122	113549	白电转债	506,784.11	0.11
123	127028	英特转债	498,547.40	0.11
124	123065	宝莱转债	469,488.22	0.10
125	128056	今飞转债	466,880.59	0.10
126	123214	东宝转债	454,911.68	0.10
127	127049	希望转 2	418,391.23	0.09
128	123209	聚隆转债	411,012.74	0.09
129	123155	中陆转债	408,133.92	0.09
130	110086	精工转债	406,946.85	0.09
131	113665	汇通转债	406,589.04	0.09
132	118018	瑞科转债	401,635.40	0.09
133	118032	建龙转债	400,503.06	0.09
134	123226	中富转债	387,772.52	0.08
135	123206	开能转债	382,802.47	0.08
136	123187	超达转债	369,593.56	0.08
137	123138	丝路转债	364,416.58	0.08
138	123130	设研转债	346,163.01	0.07
139	127059	永东转 2	327,772.19	0.07
140	123144	裕兴转债	308,102.47	0.07
141	113653	永 22 转债	267,285.27	0.06
142	127055	精装转债	259,112.05	0.06
143	118023	广大转债	258,966.57	0.06
144	127051	博杰转债	257,995.62	0.05
145	113546	迪贝转债	257,360.55	0.05
146	123232	金现转债	245,796.71	0.05
147	113058	友发转债	241,374.25	0.05
148	123217	富仕转债	233,736.00	0.05
149	113565	宏辉转债	232,386.30	0.05

150	123199	山河转债	231,524.93	0.05
151	113629	泉峰转债	229,516.71	0.05
152	111005	富春转债	220,861.64	0.05
153	123200	海泰转债	220,536.88	0.05
154	123089	九洲转 2	206,250.41	0.04
155	123218	宏昌转债	176,396.71	0.04
156	113643	风语转债	141,035.10	0.03
157	123120	隆华转债	126,673.56	0.03
158	113534	鼎胜转债	124,960.41	0.03
159	113569	科达转债	124,346.30	0.03
160	113668	鹿山转债	123,028.22	0.03
161	118039	煜邦转债	115,733.15	0.02
162	118044	赛特转债	109,118.19	0.02

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	东方双债添利债券 A	东方双债添利债 券 C	东方双债添利 债券 D
报告期期初基金份额总额	670,089,932.92	4,823,212.42	22,796.15
报告期期间基金总申购份额	299,541.93	229,416.40	44,839.03
减：报告期期间基金总赎回份额	268,865,373.26	3,000,300.37	29,637.37
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	401,524,101.59	2,052,328.45	37,997.81

注：基金总申购份额包含红利再投资、基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§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	20241001 - 20241231	184,989,874.00	-	-	184,989,874.00	45.83
产品	1	20241001 - 20241111	171,152,144.18	-	171,152,144.18	-	-
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

2025 年 1 月 22 日