

东方强化收益债券型证券投资基金

2023 年第 4 季度报告

2023 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 20 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 2024 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 2023 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方强化收益债券
基金主代码	400016
前端交易代码	400016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 10 月 9 日
报告期末基金份额总额	160,368,683.45 份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，追求稳定的当期收益和长期增值，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	基金管理人将采取积极的投资策略，寻找各种可能的价值增长机会，力争实现超越基准的投资收益。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的低风险品种，理论上其长期平均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

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）
--------	---------------------------------------

1. 本期已实现收益	-1,246,012.87
2. 本期利润	-2,587,118.25
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0156
4. 期末基金资产净值	197,896,671.75
5. 期末基金份额净值	1.2340

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。

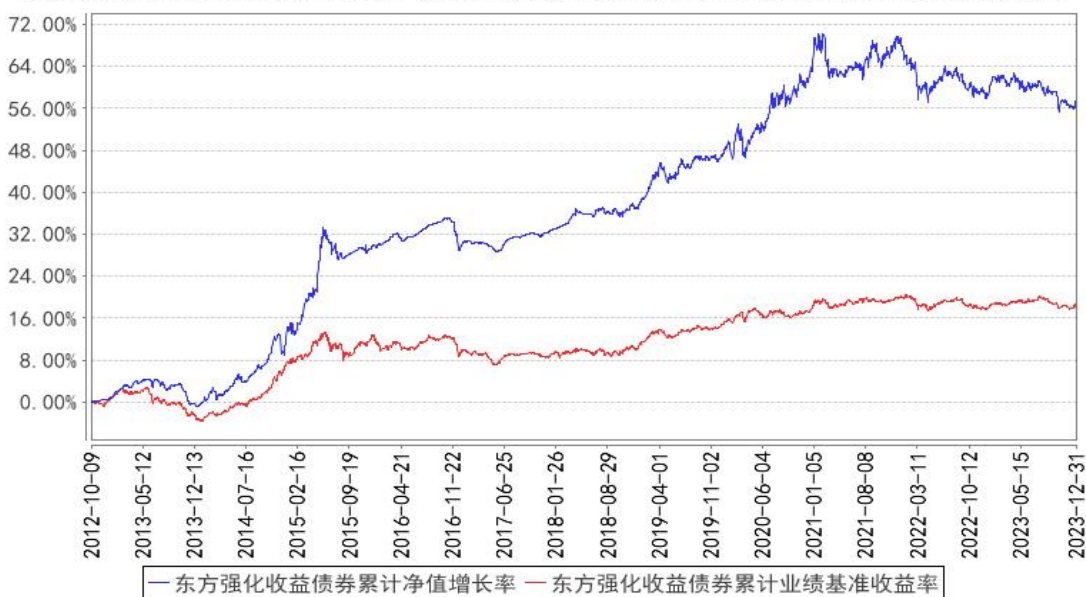
3.2 基金净值表现

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

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	-1.19%	0.20%	0.03%	0.09%	-1.22%	0.11%
过去六个月	-1.70%	0.21%	-0.35%	0.09%	-1.35%	0.12%
过去一年	-0.92%	0.22%	0.71%	0.09%	-1.63%	0.13%
过去三年	-4.72%	0.32%	0.40%	0.12%	-5.12%	0.20%
过去五年	14.73%	0.32%	7.69%	0.12%	7.04%	0.20%
自基金合同 生效起至今	57.28%	0.27%	18.82%	0.15%	38.46%	0.12%

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

东方强化收益债券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		
许文波	本基金基金经理、公司副总经理、权益投资总监、绝对收益部总经理、公募投资决策委员会副主任委员	2018年8月13日	-	22年	公司副总经理、权益投资总监、绝对收益部总经理、公募投资决策委员会副主任委员。吉林大学工商管理硕士，22年证券从业经历。曾任新华证券有限责任公司投资顾问部分析师；东北证券股份有限公司资产管理分公司投资管理部投资经理、部门经理；德邦基金管理有限公司基金经理、投资研究部总经理。2018年4月加盟本基金管理人，曾任公司总经理助理，东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方中国红利混合型证券投资基金基金经理、东方欣利混合型证券投资基金基金经理、东方欣益一年持有期偏债混合型证券投资基金基金经理，现任东方精选混合型开放式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、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理、东方欣冉九个月持有期混合型证券投资基金基金经理、东方创新医疗股票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。
张博	本基金基金经理	2022 年 5 月 20 日	-	13 年	绝对收益部部门总经理助理，北京邮电大学电磁场与微波技术专业博士，13 年证券从业经历。曾任普天信息技术研究院有限公司产业研究员、渤海证券股份有限公司高级研究员、天安财产保险股份有限公司投资经理、中信保诚人寿股份有限公司股票部主管兼投资经理、金元顺安基金管理有限公司基金部投资副总监兼基金经理。2022 年 1 月加盟本基金管理人，现任东方欣益一年持有期偏债混合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、东方民丰回报赢安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。

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遵规守信情况的说明

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、《东方强化收益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

四季度债市利率呈现持续先上后下的态势；8 月中旬，央行先后下调三大关键政策利率，十年国债利率迅速下降，最低到 2.53%；9 月份政策刺激经济回升预期，债市开始回升；10-11 月十年国债维持在 2.70% 左右；到 12 月份，经济数据持续低迷，工业增加值+PPI 同比放缓至 3.7%，制造业 PMI 持续荣枯线以下，利率开始新的下行趋势，持续至年末，最低达到 2.56%。

四季度 A 股继续震荡调整，根据 Wind 数据显示，上证指数下跌 4.4%、万得全 A 下跌 3.8%、创业板指下跌 5.6%。申万一级行业来看，仅有煤炭、电子、农林牧渔、综合四个行业上涨，其中，煤炭领涨 5.3%；美容护理、房地产、建筑材料跌幅最大，跌幅均超过 14%。

在报告期内，本基金仍然保持较为谨慎的债券配置策略，以较高等级、较短久期的思路进行配置；可转债方面采取谨慎策略，在仓位和持股选择上进行一定调整，保持相对稳健、分散的持仓结构。股票投资方面，在白酒和家电等消费龙头、重点央国企、贵金属等进行重点的配置和布局，看好高股息、经营稳定的国内重点央国企的机会。在选股思路，坚持以投资资产的角度进行研判，优选更好的产业公司，争取为投资人带来稳健的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2023 年 10 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日，本基金净值增长率为-1.19%，业绩比较基准收益

率为 0.03%，低于业绩比较基准 1.22%。

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	31,448,394.80	15.79
	其中：股票	31,448,394.80	15.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	161,111,536.14	80.87
	其中：债券	161,111,536.14	80.87
	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	5,461,451.23	2.74
8	其他资产	1,196,704.32	0.60
9	合计	199,218,086.49	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	4,080,000.00	2.06
C	制造业	18,732,363.10	9.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,171,700.00	2.61
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	970,081.70	0.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,494,250.00	1.26
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	-	-
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	31,448,394.80	15.89

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	688169	石头科技	9,200	2,603,140.00	1.32
2	688777	中控技术	55,000	2,494,250.00	1.26
3	301367	怡和嘉业	17,500	2,130,625.00	1.08
4	600886	国投电力	160,000	2,108,800.00	1.07
5	603365	水星家纺	140,000	2,013,200.00	1.02
6	600025	华能水电	230,000	1,984,900.00	1.00
7	002151	北斗星通	60,000	1,894,800.00	0.96
8	600519	贵州茅台	1,089	1,879,614.00	0.95
9	601600	中国铝业	300,000	1,692,000.00	0.85
10	002959	小熊电器	25,000	1,298,250.00	0.66

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	10,803,108.61	5.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	87,314,171.54	44.12
	其中：政策性金融债	5,088,100.00	2.57
4	企业债券	4,139,859.02	2.09
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	30,430,761.75	15.38
7	可转债（可交换债）	28,423,635.22	14.36
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	161,111,536.14	81.41

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	019694	23 国债 01	104,000	10,602,062.03	5.36
2	2028025	20 浦发银行二级 01	100,000	10,335,731.15	5.22
3	232380021	23 浙商银行二级 资本债 01	100,000	10,322,587.98	5.22
4	2120105	21 厦门银行二级 02	100,000	10,292,003.28	5.20
5	2028018	20 交通银行二级	100,000	10,275,344.26	5.19

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

本基金所持有的 20 交通银行二级的发行人交通银行（601328.SH）因存在如下违规行为而收到处罚：

根据公告显示，过去一年交通银行枣庄分行、贵安支行、贵州省分行、黑龙江省分行等多家

分支行在贷款业务中存在票据业务办理不审慎、强制搭售保险产品、违规转嫁经营成本、提供虚假报表等等违法、违规行为，国家金融监督管理总局及相关属地的监管分局分别予以了公开批评、罚款等相应的处罚措施。

本基金所持有的 20 浦发银行二级 01 的发行人浦发银行（600000.SH）因存在如下违规行为而收到处罚：

根据公告显示，过去一年浦发银行连云港分行、九江分行、宁波分行、哈尔滨分行等多家分支行在发展业务中存在理财资金违规投资、个人消费贷款贷前调查和贷后管理不尽职、未比照自营贷款对非标债权资产投资进行三查、违规办理同业业务、虚增存款业务规模等一些违法违规行。据此，中国银行保险监督管理委员会及相关属地的监管分局分别予以了公开批评、罚款等相应的处罚措施。

本基金所持有的 21 厦门银行二级 02 的发行人厦门银行（601187.SH）因存在如下违规行为而收到处罚：

根据公告显示，过去一年厦门银行莆田分行、泉州分行、福州中心支行等多家分支机构在发展业务过程中存在未准确报送金融统计数据、未按规定开展客户风险等级划分和审核工作、未按规定对高风险客户采取强化识别措施、未按规定开展持续的客户身份识别等违法、违规行为。据此，中国人民银行属地管理机构分别予以相应的警告、没收违法所得、罚款、公开批评等处罚措施。

本基金所持有的 23 浙商银行二级资本债 01 的发行人浙商银行（601916.SH）因存在如下违规行为而收到处罚：

根据公告显示，过去一年浙商银行宁波分行、衢州分行、深圳分行、南通分行等多家分支行在发展业务中存在贷款管理不审慎、函证事项审查不严、国内信用证贸易背景审核不尽职、个人贷款“三查”不尽职、小微企业贷款贷后管理不到位等违法违规行为。据此，中国银行保险监督管理委员会及相关属地的监管分局分别予以了公开批评、罚款等相应的处罚措施。

本基金所持有的 20 农业银行二级 01 的发行人农业银行（601288.SH）因存在如下违规行为而收到处罚：

根据公告显示，过去一年农业银行厦门分行、西宁分行、通化县支行、丽江分行、榆林人民路支行等多家分支行在发展业务中存在流动资金贷款用途及贷款资金支付管理控制不严、贷前调查不尽职、贷后管理不到位、因管理不善导致许可证遗失、办理抵押贷款时由借款人支付押品评估费、投资银行顾问业务收费质价不符等违法违规行为。据此，国家金融监督管理总局及相关属地的监管分局分别予以了公开批评、罚款等相应的处罚措施。

本基金所持有的 22 光大银行小微债的发行人光大银行（601818.SH）因存在如下违规行为而收到处罚：

根据公告显示，过去一年光大银行滨州分行、深圳分行、烟台分行、武汉分行、洛阳分行、等多家分支行在发展业务中存在违规转嫁经营成本、未按规定承担小微企业押品评估费、贷款管理不到位、风险分类不准确、线上经营贷业务贷后管理不到位、信贷资金被挪用、员工行为管理不到位，严重违反审慎经营规则、违规办理信用卡业务、发放贷款时搭售保险，增加企业融资成本等违法违规行。据此，国中国银行保险监督管理委员会相关属地的监管分局分别予以了公开批评、罚款等相应的处罚措施。

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 20 交通银行二级主要基于以下原因：交通银行是国内重要的全国性国有股份商业银行，近年来贷款保持稳步扩张、生息自产稳定，存款增长稳健理，财规模增长良好，息差相对平稳，在同类银行中各类指标处于较好水平，是国内比较优秀的银行。最新的债券评级和主体引用评级均为 AAA，属于风险较小，可靠性较强的债券资产。

本基金投资 20 浦发银行二级 01 主要基于以下原因：为重塑中长期发展基础，浦发银行自 2020 年起立足长三角主场优势，推进轻型银行、绿色银行和全景银行建设。目前，浦发银行营收、利润增速仍落后于同业，但资产结构、收入结构、资产质量已有所改善，整体经营仍在筑底过程中。最新的债券评级和主体评级均为 AAA，属于风险较小，可靠性较强的债券资产。

本基金投资 21 厦门银行二级 02 主要基于以下原因：厦门银行由厦门国资主导，在厦门本市拥有良好的客群基础，网点优势突出。厦门经济总量大、发展水平高。截至 2022 年末，厦门地区设有分行 2 家，支行 38 家，总行营业部 1 家。2022 年，厦门银行在厦门本市贷款市场份额 6.19%

存款份额 9.66%。厦门银行 2022 年新增 22 家网点，填补 6 个空白行政区域，客户服务覆盖面进一步扩大，目前在福州、泉州、漳州等 9 地设有 9 家分行，支行 61 家，2 家专营机构。最新的债券评级和主体评级均为 AAA，属于风险较小，可靠性较强的债券资产。

本基金投资 23 浙商银行二级资本债 01 主要基于以下原因：浙商银行是城商行增长潜力的股份行。规模为股份行最小，类似于城商行体量；增速高于股份行平均，接近于城商行平均。新管理层落定，核心高管年富力强，预计高管团队将保持稳定，经营上积极进取。深耕浙江，省内成长空间大、区位优势。省内支行数仅高于股份制中平安、华夏与光大；22Q4 末省内贷款市占率 2.6%，较宁波、杭州低 0.9pc、0.2pc。零售转型升级，补短板抗周期。22A 对公、零售资产占 48%、17%，对公、零售利润占 104%、11%。最新的债券评级和主体评级均为 AAA，属于风险较小，可靠性较强的债券资产。

本基金投资 20 农业银行二级 01 主要基于以下原因：农业银行是深耕县域、优势明显的国有控股银行，农业银行股权高度集中，金融实力雄厚，抗风险能力强。公司以高质量发展为主题，突出“服务乡村振兴的领军银行、服务实体经济的主力银行”两大定位，全面实施“三农”县域、绿色金融、数字经营三大战略。在“服务乡村振兴的领军银行的定位下，公司常年深耕县域，优势突出。

最新的债券评级和主体评级为 AAA-/AAA，属于风险较小，可靠性较强的债券资产。

本基金投资 22 光大银行小微债主要基于以下原因：光大银行资产负债和业务结构与股份行同业一致，负债端对公存款占比更高，成本刚性，资产端零售贷款占比较高，贷款增长和边际资产质量趋势偏弱，业绩和业务压力同步股份行同业。在偏弱的外部环境下，公司坚持财富银行战略，坚持服务实体和国家战略、数字化经营的发展主线，积极夯实业务基础。三季度对公综合融资（FPA）较年初增长 3.6%、零售资产管理（AUM）较年初增长 9.3%，同业金融交易额（GMV）同比增长 25.1%，战略积极推进。四季度基数下降，收入、业绩压力或缓解，阶段性业绩或仍受制于外部环境，随着公司战略持续推进，基本面持续改善可期待。

最新的债券评级和主体评级为 AAA-/AAA，属于风险较小，可靠性较强的债券资产。

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的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	15,343.37
2	应收证券清算款	1,180,366.70
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	994.25
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,196,704.32

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	3,071,070.49	1.55
2	110091	合力转债	2,870,733.15	1.45
3	127050	麒麟转债	2,782,599.18	1.41
4	110068	龙净转债	2,471,047.40	1.25
5	127058	科伦转债	2,173,240.44	1.10
6	111001	山玻转债	1,884,252.05	0.95
7	128121	宏川转债	1,863,268.64	0.94
8	127084	柳工转 2	1,800,041.10	0.91
9	127015	希望转债	1,621,571.10	0.82
10	110047	山鹰转债	1,536,774.25	0.78
11	110058	永鼎转债	1,396,757.53	0.71
12	127049	希望转 2	1,253,102.47	0.63
13	110075	南航转债	604,834.11	0.31

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

报告期期初基金份额总额	173,714,586.89
报告期期间基金总申购份额	297,648.06
减：报告期期间基金总赎回份额	13,643,551.50
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	160,368,683.45

§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	20231001 - 20231231	39,498,149.15	-	-	39,498,149.15	24.63
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、《东方强化收益债券型证券投资基金基金合同》
- 二、《东方强化收益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

2024 年 1 月 20 日