东方兴润债券型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 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 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东方兴润债券	
基金主代码	012539	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 5 日	
报告期末基金份额总额	324,747,013.63 份	
投资目标	本基金在严格控制投资风险的基础上，争取为基金份额持有人谋求长期、稳健的投资回报。	
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。	
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率×80%+中证可转换债券指数收益率×10%+沪深 300 指数收益率×5%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，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。本基金将投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	东方基金管理股份有限公司	
基金托管人	华夏银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	东方兴润债券 A	东方兴润债券 C
下属分级基金的交易代码	012539	012540
报告期末下属分级基金的份额总额	309,239,390.04 份	15,507,623.59 份

注：本基金从 2026 年 7 月 27 日起调整业绩比较基准，相关公告已于 2026 年 6 月 26 日在规定媒介上进行披露。

§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（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	东方兴润债券 A	东方兴润债券 C
1.本期已实现收益	1,597,448.23	84,226.53
2.本期利润	193,479.21	7,297.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0006	0.0004
4.期末基金资产净值	319,927,878.43	16,161,948.29
5.期末基金份额净值	1.0346	1.0422

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

东方兴润债券 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	0.07%	0.05%	-0.39%	0.13%	0.46%	-0.08%
过去六个月	0.97%	0.06%	0.37%	0.12%	0.60%	-0.06%
过去一年	2.30%	0.06%	0.12%	0.12%	2.18%	-0.06%
过去三年	12.04%	0.05%	7.78%	0.12%	4.26%	-0.07%
过去五年	10.89%	0.21%	7.18%	0.12%	3.71%	0.09%
自基金合同生效起至今	10.03%	0.21%	6.46%	0.12%	3.57%	0.09%

东方兴润债券 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	①－③	②－④

				④		
过去三个月	0.04%	0.05%	-0.39%	0.13%	0.43%	-0.08%
过去六个月	0.91%	0.06%	0.37%	0.12%	0.54%	-0.06%
过去一年	2.20%	0.06%	0.12%	0.12%	2.08%	-0.06%
过去三年	11.66%	0.05%	7.78%	0.12%	3.88%	-0.07%
过去五年	11.54%	0.21%	7.18%	0.12%	4.36%	0.09%
自基金合同生效起至今	10.66%	0.21%	6.46%	0.12%	4.20%	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





§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		
车日楠	本基金基金经理、固定收益研究部总经理、公募投资决策委员会委员	2023 年 7 月 3 日	-	11 年	固定收益研究部总经理、公募投资决策委员会委员，北京交通大学计算数学专业硕士，11 年证券从业经历。2015 年 7 月加盟本基金管理人，曾任固定收益研究部研究员、交易部债券交易员、固定收益研究部副总经理，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助理、东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理助理、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、东方成长回报平衡混合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、东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方价值挖掘灵活配置混合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、东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻善纯债债券型证券投资基金基金经理，现任东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻萃 3 个月定期开放纯债债券型证券投

					资基金基金经理、东方永悦 18 个月定期开放纯债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、东方兴润债券型证券投资基金基金经理、东方中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金基金经理、东方享悦 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理、东方卓行 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方享誉 30 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理。
徐奥千	本基金基金经理	2025 年 8 月 7 日	-	10 年	维多利亚大学经济专业硕士，10 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、东方招益债券型证券投资基金基金经理，现任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、东方民丰回报赢安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、《东方兴润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，未直接或通过与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

复盘三季度债券市场表现来看，弱修复的基本面、平稳偏松的流动性和不断发散的政策预期共同推动债市震荡走强。7 月上中旬，经历了二季度交易盘压利差行情后，债市短暂进入震荡期，机构整体偏观望态度；7 月下旬，部分省市存款利率调降、政策预期发散和国债期货大幅增仓推动现券市场下行，债市震荡偏强，超长债领涨，直至 8 月中旬。进入 8 月中下旬，长端、超长端受机构止盈情绪和资金面边际收敛的共同影响偏向震荡调整，但整体调整幅度不大，10 年国债收益率触及 1.70 %、30 年国债收益率触及 2.15%；同时第一批 63 个月摊余债基提交审批材料，点燃 5 年品种行情，信用品种逐步扩散至 3-5 年品种轮动。9 月上旬，资金面持续保持宽松，宽货币预期小幅升温，但政府债发行偏集中、部分宏观指标表现较好，引发债市调整；随后进入 9 月

中旬，经济金融数据偏弱，强化了基本面对债市支撑，国债期货再度超预期增仓，叠加央行多期限呵护跨季流动性和权益市场表现平淡，推动债市在调整后重归下行；临近季末，债市演绎宽货币预期，10 年国债收益率行至 1.67%之下、30 年国债收益率接近 2.07%；随后三季度货政例会提及“关注长期收益率变化”、国常会强调政策逆周期调节、9 月 29 日房贷贴息、PSL 降价扩围等政策组合落地，叠加长假前机构主动止盈降仓，市场明显调整。截至 9 月 30 日，10 年国债收益率收于 1.68%、30 年国债收益率收于 2.10%。

权益市场方面，三季度风险偏好受全球流动性环境影响下降，A 股市场从前期的科技赛道集中度偏高转向风格再平衡和宽幅震荡。7 月，海外流动性环境转向，日韩央行相继流露加息预期，美联储加息预期受油价中枢抬升影响升温，主题行情集中度降低，防御性和相对低估值的类红利资产表现相对较好；8 月，密集中报披露下，业绩兑现较强的科技成长方向出现反弹修复；但 9 月美债利率快速飙升，流动性承压下市场风偏回落，权益市场再度下探。整体上，三季度风格从科技制造向消费、金融、地产链再平衡。

可转债方面，三季度转债市场整体随权益震荡回落，相较正股表现出一定抗跌属性，但回暖修复时跟涨动能不足，全市场溢价率持续压缩。7 月正股调整带动转债下行，债底支撑下回撤相对温和；8 月权益反弹时，受高估值影响，转债跟涨乏力，高价券补杀溢价现象突出；进入 9 月，风偏再度承压，转债估值加速下行，偏股型品种受强赎约束更为明显，价格调整未能充分转化为配置性价比。在行情风格极致分化下，转债指数整体表现一般，高股性策略阶段占优但后段回吐，双低与纯债底仓防御效力减弱。

操作方面，报告期内组合灵活调整大类资产配置比例，纯债部分维持高等级信用债的票息策略，关注个券定价偏差带来的交易机会，并适时进行利率品种交易；转债方面维持双低转债为底仓，配合量化模型参考和主观调研结果，灵活参与交易，并积极参与新券定价机会，以期增厚组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日,本基金 A 类净值增长率为 0.07%，业绩比较基准收益率为-0.39%，高于业绩比较基准 0.46%；本基金 C 类净值增长率为 0.04%，业绩比较基准收益率为-0.39%，高于业绩比较基准 0.43%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	332,533,811.50	98.85
	其中：债券	332,533,811.50	98.85
	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	3,827,389.32	1.14
8	其他资产	38,241.19	0.01
9	合计	336,399,442.01	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

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

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	30,035,597.26	8.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	214,532,513.97	63.83
	其中：政策性金融债	40,516,986.30	12.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	71,546,683.29	21.29
7	可转债（可交换债）	16,419,016.98	4.89

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	332,533,811.50	98.94

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	09240202	24 国开清发 02	400,000	40,516,986.30	12.06
2	092280108	22 中行二级资本债 02A	300,000	31,326,156.16	9.32
3	102485100	24 汇金 MTN008	300,000	30,724,939.73	9.14
4	232680001	26 工行二级资本债 01BC	300,000	30,579,821.92	9.10
5	232680008	26 渤海银行二级资本债 01	300,000	30,576,649.32	9.10

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 24 国开清发 02（09240202.IB）发行人国家开发银行（以下简称“国开行”）受到行政处罚。国开行因未依法履行其他职责等，被国家金融监督管理总局、中国人民银行公开处罚。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 22 中行二级资本债 02A（092280108.IB）发行人中国银行股份有限公司（以下简称“公司”）受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责等，被深圳证券交易所、国家金融监督管理总局、中国人民银行、国家外汇管理局、中国证券监督管理委员会公开处罚。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 26 渤海银行二级资本债 01（232680008.IB）发行人渤海银行股份有限公司（以下简称“公司”）受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责等，被国家金融监督管理总局、中国人民银行、国家外汇管理局公开处罚。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 26 工行二级资本债 01BC（232680001.IB）发行人中国工商银行股份有限公司（以下简称“公司”）受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责等，被国家金融监督管理总局、中国人民银行、国家外汇管理局公开处罚。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 26 邮储银行二级资本债 01BC（232680012.IB）发行人中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“公司”）受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责等，被国家金融监督管理总局、中国人民银行、国家外汇管理局、中国证券监督管理委员会、中国银行间市场交易商协会公开处罚。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 26 农行 TLAC 非资本债 01A(BC)（312610001.IB）发行人中国农业银行股份有限公司（以下简称“公司”）受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责等，被国家金融监督管理总局、中国人民银行、国家外汇管理局公开处罚。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 26 交行 TLAC 非资本债 01BC（312610005.IB）发行人交通银行股份有限公司（以下简称“公司”）受到行政处罚。公司因未依法履行其他职责等，被国家金融监督管理总局、中国人民银行、国家外汇管理局、香港证券及期货事务监察委员会公开处罚。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支持，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，基金经理基于投研部门的支持，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。

本基金投资 22 中行二级资本债 02A（092280108.IB）、26 渤海银行二级资本债 01（232680008.IB）、26 工行二级资本债 01BC（232680001.IB）、26 邮储银行二级资本债 01BC（232680012.IB）、26 农行 TLAC 非资本债 01A(BC)（312610001.IB）、26 交行 TLAC 非资本债 01BC（312610005.IB）基于以下原因：

以上债券主体评级为 AAA，表明发行人偿还债务的能力较强，受不利经济环境的影响不大，违约风险较低。

本基金投资 24 国开清发 02（09240202.IB）基于以下原因：

该债券为政策银行债，发行人偿还债务的能力较强，受不利经济环境的影响不大，违约风险

较低。

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约定的备选股票库

本报告期内本基金未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,743.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	35,497.56
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	38,241.19

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	123255	鼎龙转债	484,859.34	0.14
2	113673	岱美转债	389,493.15	0.12
3	118065	艾为转债	346,735.26	0.10
4	118062	天准转债	310,596.88	0.09
5	123259	锦浪转 02	290,805.97	0.09
6	127110	广核转债	273,067.29	0.08
7	127112	尚太转债	271,206.19	0.08
8	113696	伯 25 转债	262,280.99	0.08
9	123124	晶瑞转 2	260,403.29	0.08
10	123262	神宇转债	255,077.75	0.08
11	123091	长海转债	248,392.33	0.07
12	113652	伟 22 转债	240,700.22	0.07
13	127045	牧原转债	235,923.29	0.07
14	123257	安克转债	233,766.09	0.07
15	127038	国微转债	222,650.68	0.07
16	127095	广泰转债	219,456.31	0.07
17	118035	国力转债	217,717.40	0.06
18	111002	特纸转债	213,634.76	0.06
19	111021	奥锐转债	213,003.97	0.06
20	111004	明新转债	211,237.92	0.06

21	127103	东南转债	210,726.36	0.06
22	111003	聚合转债	204,209.59	0.06
23	113678	中贝转债	201,453.99	0.06
24	113691	和邦转债	201,360.62	0.06
25	127111	金威转债	200,336.42	0.06
26	123189	晓鸣转债	200,073.37	0.06
27	118042	奥维转债	199,521.53	0.06
28	123109	昌红转债	195,004.93	0.06
29	127072	博实转债	193,928.26	0.06
30	123133	佩蒂转债	191,820.82	0.06
31	123253	永贵转债	191,260.64	0.06
32	123180	浙矿转债	190,690.89	0.06
33	113062	常银转债	190,193.38	0.06
34	127059	永东转 2	188,417.26	0.06
35	123196	正元转 02	188,348.63	0.06
36	111018	华康转债	184,696.44	0.05
37	123104	卫宁转债	184,473.49	0.05
38	127108	太能转债	182,000.92	0.05
39	127054	双箭转债	180,847.93	0.05
40	113666	爱玛转债	179,554.93	0.05
41	110093	神马转债	175,130.10	0.05
42	118034	晶能转债	173,533.77	0.05
43	118063	金 05 转债	135,211.37	0.04
44	127064	杭氧转债	134,642.60	0.04
45	111015	东亚转债	132,996.03	0.04
46	113688	国检转债	130,925.97	0.04
47	127105	龙星转债	129,534.33	0.04
48	123252	银邦转债	126,544.08	0.04
49	113056	重银转债	125,332.05	0.04
50	110090	爱迪转债	124,886.30	0.04
51	111022	锡振转债	124,073.64	0.04
52	127078	优彩转债	122,886.44	0.04
53	123215	铭利转债	120,963.97	0.04
54	110086	精工转债	120,679.12	0.04
55	118024	冠宇转债	120,444.38	0.04
56	110087	天业转债	120,004.52	0.04
57	127102	浙建转债	119,678.22	0.04
58	113042	上银转债	117,473.01	0.03
59	127068	顺博转债	116,109.18	0.03
60	113648	巨星转债	113,284.11	0.03
61	113698	凯众转债	106,688.96	0.03
62	118036	力合转债	98,491.63	0.03

63	123178	花园转债	97,689.99	0.03
64	113681	镇洋转债	95,538.76	0.03
65	113631	皖天转债	91,770.06	0.03
66	127082	亚科转债	90,438.08	0.03
67	110095	双良转债	90,046.03	0.03
68	123247	万凯转债	89,540.41	0.03
69	113058	友发转债	88,766.90	0.03
70	123165	回天转债	65,252.26	0.02
71	113659	莱克转债	64,903.63	0.02
72	123183	海顺转债	64,525.62	0.02
73	113649	丰山转债	63,845.41	0.02
74	113674	华设转债	62,388.36	0.02
75	113682	益丰转债	62,351.23	0.02
76	118015	芯海转债	62,029.37	0.02
77	127050	麒麟转债	59,429.12	0.02
78	113656	嘉诚转债	58,210.75	0.02
79	127027	能化转债	54,961.58	0.02
80	128136	立讯转债	54,147.67	0.02
81	127061	美锦转债	53,999.32	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	东方兴润债券 A	东方兴润债券 C
报告期期初基金份额总额	310,426,527.26	19,607,748.63
报告期期间基金总申购份额	1,019,468.23	2,289,262.96
减:报告期期间基金总赎回份额	2,206,605.45	6,389,388.00
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	309,239,390.04	15,507,623.59

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	20260701 - 20260930	301,458,412.15	-	-	301,458,412.15	92.83
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、《东方兴润债券型证券投资基金基金合同》

二、《东方兴润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

2026 年 10 月 27 日