

# 东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金

## 招募说明书（更新）摘要

（2017 年第 1 号）

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



## 重要提示

东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2015 年 3 月 13 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2015] 392 号）和《关于东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金募集时间安排的确认函》（机构部函[2015]713 号）核准募集。本基金基金合同于 2015 年 5 月 4 日正式生效。

东方基金管理有限责任公司（以下简称“本基金管理人”）保证《东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，请认真阅读本招募说明书和《东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金投资过程中产生的操作风险、因交收违约和投资债券引发的信用风险、基金投资对象与投资策略引致的特有风险等等。

本基金对固定收益类资产的投资中将中小企业私募债券纳入到投资范围当中，中小企业私募债券，是根据相关法律法规由非上市的中小企业以非公开方式发行的债券。该类债券不能公开交易，可通过上海证券交易所固定收益证券综合电子平台或深圳证券交易所综合协议交易平台进行交易。一般情况下，中小企业私募债券的交易不活跃，潜在流动性风险较大；并且，当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性限制，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券，从而可能给基金净值带来损失。

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。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

基金管理人于 2016 年 4 月 18 日在基金管理人网站发布《关于变更东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金业绩比较基准并修改基金合同的公告》，决定变更本基金的业绩比较基准，由“同期三年期银行定期存款基准利率×金融机构存款利率浮动区间上限×1.5”变更为“同期三年期银行定期存款基准利率×1.5”，并且修改基金合同相应条款。基金管理人于 2016 年 4 月 18 日在基金管理人网站对修订后的基金合同进行了披露。上述文件可通过本基金管理人网站查阅。

基金管理人于 2016 年 10 月 28 日在基金管理人网站发布《东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告》，本基金的第一个封闭期为自 2015 年 5 月 4 日起至 2016 年 11 月 4 日止。本基金第二次办理申购与赎回业务的开放期为 2016 年 11 月 4 日之后第一个工作日起 20 个工作日的期间，即 2016 年 11 月 7 日至 2016 年 12 月 2 日，共计 20 个工作日。自 2016 年 12 月 3 日起至 2018 年 6 月 2 日止，为本基金的第二个封闭期，封闭期内本基金不办理申购与赎回业务，也不上市交易。详情请参阅基金管理人网站相关公告。

有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 3 月 31 日（财务数据未经审计），如无其他特别说明，本招募说明书其他所载内容截止日为 2017 年 5 月 4 日。

## 一、基金合同生效日期

2015 年 5 月 4 日

## 二、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

邮政编码：100033

法定代表人：崔伟

成立时间：2004 年 6 月 11 日

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；从事境外证券投资管理业务；中国证监会许可的其他业务

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]80 号

统一社会信用代码：911100007635106822

联系人：李景岩

电话：010-66295888

股权结构：

股东名称	出资金额（人民币）	出资比例
东北证券股份有限公司	12,800 万元	64%
河北省国有资产控股运营有限公司	5,400 万元	27%
渤海国际信托股份有限公司	1,800 万元	9%
合计	20,000 万元	100%

内部组织结构：

股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会，董事会下设合规与风险控制委员会、薪酬与考核委员会；公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制，

下设投资决策委员会、产品委员会、IT 治理委员会、风险控制委员会和权益投资部、固定收益部、量化投资部、专户投资部、市场部、产品开发部、电子商务部、机构业务一部、机构业务二部、运营部、交易部、信息技术部、财务部、人力资源部、综合管理部、董事会办公室、风险管理部、监察稽核部十八个职能部门及上海分公司、北京分公司、广州分公司、成都分公司；公司设督察长，分管风险管理部、监察稽核部，负责组织指导公司的监察稽核工作。

## （二）基金管理人主要人员情况

### 1、董事会成员

崔伟先生，董事长，经济学博士。历任中国人民银行副主任科员、主任科员、副处级秘书，中国证监会党组秘书、秘书处副处长、处长，中国人民银行东莞中心支行副行长、党委委员，中国人民银行汕头中心支行行长、党委书记兼国家外汇管理局汕头中心支局局长，中国证监会海南监管局副局长兼党委委员、局长兼党委书记，中国证监会协调部副主任兼中国证监会投资者教育办公室召集人；现任东方基金管理有限责任公司董事长，兼任东北证券股份有限公司副董事长、吉林大学商学院教师、中国证券投资基金业协会理事、东方汇智资产管理有限公司董事长。

张兴志先生，董事，硕士，研究员。历任吉林省经济体制改革委员会宏观处处长，吉林省体改委产业与市场处处长，吉林亚泰（集团）股份有限公司总裁助理、副总裁，东北证券有限责任公司副总裁、东证融达投资有限公司董事、副总经理；现任东北证券股份有限公司副总裁、纪委书记，兼任吉林省证券业协会监事长。

何俊岩先生，董事，硕士，高级会计师、中国注册会计师、中国注册资产评估师，吉林省五一劳动奖章获得者。历任吉林省五金矿产进出口公司计划财务部财务科长，东北证券有限责任公司计划财务部总经理、客户资产管理总部总经理，福建凤竹纺织科技股份有限公司财务总监，东北证券有限责任公司财务总监，东北证券股份有限公司副总裁、常务副总裁，东证融达投资有限公司董事，东证融通投资管理有限公司董事，东方基金管理有限责任公司监事会主席；现任东北证券股份有限公司总裁、董事，东证融成资本管理有限公司董事长，兼任吉林省证券业协会副会长，吉林省总会计师协会副会长，渤海期货股份有限公司董事，东证融汇证券资产管理有限公司董事。

郭兴哲先生，董事，硕士，高级经济师。历任唐山钢铁公司技术员、调度，河北省委科教部干部，河北省经济体制改革委员会干部，河北省体改委证管办副主任，河北省证券委员会国内业务处处长、综合处处长，中国证监会石家庄特派员办公室综合处调研员，河北证券有限责任公司总裁、顾问；现任河北省国有资产控股运营有限公司副总裁、党委常委，兼任河北国控置业开发有限公司党委书记、董事长，北京河北大厦有限公司党委书记、董事长，河北卓城企业管理服务有限公司董事、总经理。

陈雷先生，董事，大学本科。历任北京清华消防研究所秘书，深圳国土资源与房产管理局产权科科长，华安财产保险股份有限公司行政管理部秘书、公司治理室副主任、董事会办公室主任助理，渤海国际信托股份有限公司董事会办公室副主任、主任。现任渤海国际信托股份有限公司董事会秘书。

雷小玲女士，独立董事，北京大学 EMBA，中国注册会计师。历任贵阳市财经学校会计专业教师，贵州省财经学院会计学系教师，海南会计师事务所注册会计师，证监会发行部发行审核委员，亚太中汇会计师事务所有限公司副主任会计师。现任中审众环会计师事务所海南分所所长，兼任海南省注册会计师协会专业技术咨询委员会主任委员。

陈守东先生，独立董事，经济学博士。历任通化煤矿学院教师，吉林大学数学系教师，吉林大学经济管理学院副教授，吉林大学商学院教授、博士生导师；现任吉林大学数量经济研究中心教授、博士生导师，兼任通化葡萄酒股份有限公司独立董事，中国金融学年会常务理事，吉林省现场统计学会副理事长，吉林省法学会金融法学会副会长及金融法律专家团专家。

刘峰先生，独立董事，大学本科。历任湖北省黄石市律师事务所副主任，海南方圆律师事务所主任；现任上海市锦天城律师事务所高级合伙人，兼任梓昆科技（中国）股份有限公司独立董事，中华全国律师协会律师发展战略研究委员会副主任，金融证券委员会委员，中国国际经济，科技法律学会理事，并被国家食品药品监督管理总局聘为首批餐饮服务食品安全法律组专家。

刘鸿鹏先生，董事，吉林大学行政管理硕士。曾任吉林物贸股份有限公司投资顾问，君安证券有限责任公司长春办事处融资融券专员，吉林省信托营业部筹建负

责人，新华证券股份有限公司长春同志街营业部副经理，经理，东北证券股份有限公司杭州营业部经理、营销管理总部副经理、经理。2011 年 5 月加盟本公司，历任总经理助理兼市场总监、市场部经理，公司副总经理；现任公司总经理。

## 2、监事会成员

赵振兵先生，监事会主席，本科，高级经济师。历任河北华联商厦团委副书记、总经理助理、副总经理，河北省商贸集团经营二公司副总经理，河北省工贸资产经营有限公司改革发展处副处长，河北省国有资产控股运营有限公司团委书记、企业管理部副部长、资产运营部部长、副总裁；现任河北省国有资产控股运营有限公司总裁、党委副书记、副董事长，兼任河北国控资本管理有限公司董事长、党委书记、华北铝业有限公司副董事长。

杨晓燕女士，监事，硕士研究生，高级经济师。曾任职北京银行等金融机构，20 年金融、证券从业经历；现任东方基金管理有限责任公司风险管理部总经理，兼任监察稽核部总经理。

肖向辉先生，监事，本科。曾任职北京市化学工业研究院、中国工商银行总行；现任东方基金管理有限责任公司运营部执行总经理。

## 3、其他高级管理人员

崔伟先生，董事长，简历请参见董事介绍。

刘鸿鹏先生，总经理，简历请参见董事介绍。

秦熠群先生，副总经理，兼任东方汇智董事，中央财经大学经济学博士。历任中央财经大学经济学院副院长、学校分部副主任等职务。2011 年 7 月加盟本公司，历任董办主任、董秘、总经理助理等职务，期间曾兼任人力资源部、综合管理部、风险管理部等部门总经理职务。

李景岩先生，督察长，硕士研究生，中国注册会计师。历任东北证券股份有限公司延吉证券营业部财务经理、北京管理总部财务经理。2004 年 6 月加盟本公司，历任财务主管，财务部经理，财务负责人，综合管理部经理兼人力资源部经理、总经理助理。

## 4、本基金基金经理

姓名	任职时间	简历
----	------	----



周薇 (女士)	2015-5-20 至今	中国人民银行研究生部金融学博士，8 年证券从业经历，曾任中国银行总行外汇期权投资经理。2012 年 7 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任固定收益部债券研究员、投资经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理。现任东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方惠新灵活配置混合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、东方新价值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、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方永熙 18 个月定期开放债券型证券投资基金。
徐昀君 (先生)	2015 年 5 月 4 日至 2016 年 11 月 3 日担任本基金基金经理。	
李仆 (先生)	2015 年 5 月 4 日至 2017 年 3 月 24 日担任本基金基金经理。	

#### 5、投资决策委员会成员

刘鸿鹏先生，总经理，投资决策委员会主任委员，简历请参见董事介绍。

刘志刚先生，量化投资部总经理，投资决策委员会委员，东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金经理。吉林大学数量经济学博士，9 年基金从业经历。历任工银瑞信基金管理有限公司产品开发部产品开发经理、安信基金管理有限责任公司市场部副总经理兼产品开发总监。2013 年 5 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任指数与量化投资部总经理、专户业务部总经理、产品开发部总经理、投资经理、东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金（自 2015 年 12 月 3 日起转型为东方启明量化先锋混合型证券投资基金）基金经理。

朱晓栋先生，对外经济贸易大学经济学硕士，8 年证券从业经历。2009 年 12 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任研究部金融行业、固定收益研究、食品饮料行业、建筑建材行业研究员，东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方核心动力股票型开放式证券投资基金（于 2015 年 7 月 31 日更名为东方核心动力混合型证券投资基金）基金经理。

现任权益投资部副总经理、投资决策委员会委员、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合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、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方区域发展混合型证券投资基金基金经理。

徐昀君先生，对外经济贸易大学金融学硕士，CFA，FRM，9 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，曾任固定收益部总经理助理、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。现任固定收益部副总经理，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。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金托管人

#### （一）基金托管人概况

##### 1、基本情况

名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

成立时间：1996 年 2 月 7 日

基金托管业务批准文号：证监基金字 [2004] 101 号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：28,365,585,227 元人民币

存续期间：持续经营

电话：010-58560666

联系人：罗菲菲

中国民生银行是我国首家主要由非公有制企业入股的全国性股份制商业银行，同时又是严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的规范的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的涉足和实现规范的现代企业制度，使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行，而为国内外经济界、金融界所关注。中国民生银行成立二十年来，业务不断拓展，规模不断扩大，效益逐年递增，并保持了快速健康的发展势头。

2000 年 12 月 19 日，中国民生银行 A 股股票（600016）在上海证券交易所挂牌上市。2003 年 3 月 18 日，中国民生银行 40 亿可转换公司债券在上交所正式挂牌交易。2004 年 11 月 8 日，中国民生银行通过银行间债券市场成功发行了 58 亿元人民币次级债券，成为中国第一家在全国银行间债券市场成功私募发行次级债券的商业银行。2005 年 10 月 26 日，民生银行成功完成股权分置改革，成为国内首家完成股权分置改革的商业银行，为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例。2009 年 11 月 26 日，中国民生银行在香港交易所挂牌上市。

中国民生银行自上市以来，按照“团结奋进，开拓创新，培育人才；严格管理，规范行为，敬业守法；讲究质量，提高效益，健康发展”的经营发展方针，在改革发展与管理等方面进行了有益探索，先后推出了“大集中”科技平台、“两率”考核机制、“三卡”工程、独立评审制度、八大基础管理系统、集中处理商业模式及事业部改革等制度创新，实现了低风险、快增长、高效益的战略目标，树立了充满生机与活力的崭新的商业银行形象。

2010 年 2 月 3 日，在“卓越 2009 年度金融理财排行榜”评选活动中，中国民生银行一流的电子银行产品和服务获得了专业评测公司、网友和专家的一致好评，荣获卓越 2009 年度金融理财排行榜“十佳电子银行”奖。

2010 年 10 月，在经济观察报主办的“2009 年度中国最佳银行评选”中，民生银行获得评委会奖——“中国银行业十年改革创新奖”。这一奖项是评委会为表彰在公司治理、激励机制、风险管理、产品创新、管理架构、商业模式六个方面创新

表现卓越的银行而特别设立的。

2011 年 12 月，在由中国金融认证中心（CFCA）联合近 40 家成员行共同举办的 2011 中国电子银行年会上，民生银行荣获“2011 年中国网上银行最佳网银安全奖”。这是继 2009 年、2010 年荣获“中国网上银行最佳网银安全奖”后，民生银行第三次获此殊荣，是第三方权威安全认证机构对民生银行网上银行安全性的高度肯定。

2012 年 6 月 20 日，在国际经济高峰论坛上，民生银行贸易金融业务以其 2011-2012 年度的出色业绩和产品创新最终荣获“2012 年中国卓越贸易金融银行”奖项。这也是民生银行继 2010 年荣获英国《金融时报》“中国银行业成就奖—最佳贸易金融银行奖”之后第三次获此殊荣。

2012 年 11 月 29 日，民生银行在《The Asset》杂志举办的 2012 年度 AAA 国家奖项评选中获得“中国最佳银行-新秀奖”。

2013 年度，民生银行荣获中国投资协会股权和创业投资专业委员会年度中国优秀股权和创业投资中介机构“最佳资金托管银行”及由 21 世纪传媒颁发的 2013 年 PE/VC 最佳金融服务托管银行奖。

2013 年荣获中国内部审计协会民营企业内部审计优秀企业。

在第八届“21 世纪亚洲金融年会”上，民生银行荣获“2013·亚洲最佳投资金融服务银行”大奖。

在“2013 第五届卓越竞争力金融机构评选”中，民生银行荣获“2013 卓越竞争力品牌建设银行”奖。

在中国社科院发布的《中国企业社会责任蓝皮书（2013）》中，民生银行荣获“中国企业上市公司社会责任指数第一名”、“中国民营企业社会责任指数第一名”、“中国银行业社会责任指数第一名”。

在 2013 年第十届中国最佳企业公民评选中，民生银行荣获“2013 年度中国最佳企业公民大奖”。

2013 年还获得年度品牌金博奖“品牌贡献奖”。

2014 年获评中国银行业协会“最佳民生金融奖”、“年度公益慈善优秀项目奖”。

2014 年荣获《亚洲企业管治》“第四届最佳投资者关系公司”大奖和“2014 亚洲企业管治典范奖”。

2014 年被英国《金融时报》、《博鳌观察》联合授予“亚洲贸易金融创新服务”

称号。

2014 年还荣获《亚洲银行家》“中国最佳中小企业贸易金融银行奖”，获得《21 世纪经济报道》颁发的“最佳资产管理私人银行”奖，获评《经济观察》报“年度卓越私人银行”等。

2015 年度，民生银行在《金融理财》举办的 2015 年度金融理财金貔貅奖评选中荣获“金牌创新力托管银行奖”。

2015 年度，民生银行荣获《EUROMONEY》2015 年度“中国最佳实物黄金投资银行”称号。

2015 年度，民生银行连续第四次获评《企业社会责任蓝皮书（2015）》“中国银行业社会责任发展指数第一名”。

2015 年度，民生银行在《经济观察报》主办的 2014-2015 年度中国卓越金融奖评选中荣获“年度卓越创新战略创新银行”和“年度卓越直销银行”两项大奖。

## 2、主要人员情况

杨春萍：女，北京大学本科、硕士。资产托管部副总经理。曾就职于中国投资银行总行，意大利联合信贷银行北京代表处，中国民生银行金融市场部和资产托管部。历任中国投资银行总行业务经理，意大利联合信贷银行北京代表处代表，中国民生银行金融市场部处长、资产托管部总经理助理、副总经理等职务。具有近三十年的金融从业经历，丰富的外资银行工作经验，具有广阔的视野和前瞻性的战略眼光。

## 3、基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于 2004 年 7 月 9 日获得基金托管资格，成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势，大力发展托管业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则，高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工 68 人，平均年龄 36 岁，100%员工拥有大学本科以上学历，80%以上员工具有硕士以上文凭。基金业务人员 100%都具有基金从业资格。

中国民生银行坚持以客户需求为导向，秉承“诚信、严谨、高效、务实”的经营理念，依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台，

为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。截至 2017 年 3 月 31 日，中国民生银行已托管 164 只证券投资基金，托管的证券投资基金总净值达到 5007.92 亿元。中国民生银行于 2007 年推出“托付民生·安享财富”托管业务品牌，塑造产品创新、服务专业、效益优异、流程先进、践行社会责任的托管行形象，赢得了业界的高度认可和客户的广泛好评，深化了与客户的战略合作。自 2010 年至今，中国民生银行荣获《金融理财》杂志颁发的“最具潜力托管银行”、“最佳创新托管银行”和“金牌创新力托管银行”奖，荣获《21 世纪经济报道》颁发的“最佳金融服务托管银行”奖。

## （二）基金托管人的内部控制制度说明

### 1、内部控制目标

强化内部管理，保障国家的金融方针政策及相关法律法规贯彻执行，保证自觉合规依法经营，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系，保障业务正常运行，维护基金份额持有人及基金托管人的合法权益。

### 2、内部风险控制组织结构

中国民生银行股份有限公司基金托管业务内部风险控制组织结构由中国民生银行股份有限公司审计部、资产托管部内设风险监督中心及资产托管部各业务中心共同组成。总行审计部对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内设独立、专职的风险监督中心，负责拟定托管业务风险控制工作总体思路与计划，组织、指导、协调、监督各业务中心风险控制工作的实施。各业务中心在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部风险控制原则

（1）全面性原则：风险控制必须覆盖资产托管部的所有中心和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

（2）独立性原则：资产托管部设立独立的风险监督中心，该中心保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

（3）相互制约原则：各中心在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

（4）定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更

具客观性和操作性。

(5) 防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

#### 4、内部风险控制制度和措施

(1) 制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2) 建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

(3) 风险识别与评估：风险监督中心指导业务中心进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

(4) 相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

(5) 人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

(6) 应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

#### 5、资产托管部内部风险控制

中国民生银行股份有限公司从控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、监控等五个方面构建了托管业务风险控制体系。

(1) 坚持风险管理与业务发展同等重要的理念。托管业务是商业银行新兴的中间业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题新情况不断出现，中国民生银行股份有限公司资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(2) 实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。中国民生银行股份有限公司资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务中心和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(3) 建立分工明确、相互牵制的风险控制组织结构。托管部通过建立纵向双人制，横向多中心制的内部组织结构，形成不同中心、不同岗位相互制衡的组织结构。

(4) 以制度建设作为风险管理的核心。中国民生银行股份有限公司资产托管部十分重视内部控制制度的建设，已经建立了一整套内部风险控制制度，包括业务管理办法、内部控制制度、员工行为规范、岗位职责及涵括所有后台运作环节的操作手册。以上制度随着外部环境和业务的发展还会不断增加和完善。

(5) 制度的执行和监督是风险控制的关键。制度执行比编写制度更重要，制度落实检查是风险控制管理的有力保证。中国民生银行股份有限公司资产托管部内部设置专职风险监督中心，依照有关法律规章，定期对业务的运行进行稽核检查。总行审计部也不定期对资产托管部进行稽核检查。

(6) 将先进的技术手段运用于风险控制中。在风险管理中，技术控制风险比制度控制风险更加可靠，可将人为不确定因素降至最低。托管业务系统需求不仅从业务方面而且从风险控制方面都要经过多方论证，托管业务技术系统具有较强的自动风险控制功能。

### (三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。



## 四、相关服务机构

### （一）直销机构

#### 1、柜台交易

名称：东方基金管理有限责任公司直销中心

住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

法定代表人：崔伟

办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 3 层

联系人：孙桂东

电话：010—66295921

传真：010—66578690

网址：[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com)

#### 2、电子交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本公司网站查询。

网址：[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com)

### （二）其他销售机构

#### 1、中国民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

联系人：刘健

电话：010-57092637

传真：010-57092611

客户服务电话：95568

网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

#### 2、兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市江宁路 168 号兴业大厦 9 楼

法定代表人：高建平

联系人：刘玲

电话：021-52629999

传真：021-62569070

客户服务电话：95561

网址：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

### 3、招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83077278

传真：0755-83195109

客户服务电话：95555

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

### 4、吉林银行股份有限公司

住所：吉林省长春市东南湖大路 1817 号

办公地址：吉林省长春市东南湖大路 1817 号

法定代表人：唐国兴

联系人：孟明

电话：0431-84992680

传真：0431-84992649

客户服务电话：400-88-96666(全国)、96666(吉林省)

网址：[www.jlbank.com.cn](http://www.jlbank.com.cn)

### 5、长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

联系人：奚博宇

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

网址：www.95579.com

#### 6、东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市净月开发区生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

联系人：潘锴

电话：0431-85096709

客户服务电话：4006000686

网址：www.nesc.cn

#### 7、东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

联系人：梁旭

电话：021-20333333

传真：021-50498825

客户服务电话：95531 或 400-888-8588

网址：www.longone.com.cn

#### 8、东莞证券股份有限公司

住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 30 楼

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

联系人：孙旭

电话：0769-22119348

客户服务电话：961130（省内直拨，省外请加拨区号 0769）

网址：[www.dgzq.com.cn](http://www.dgzq.com.cn)

#### 9、光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号 3 楼

法定代表人：薛峰

联系人：李芳芳

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：95525

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

#### 10、广发证券股份有限公司

住所：广东省广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广州市天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41、42、43、44 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87555305

客户服务电话：95575

网址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

服务电话：021-95553、400-8888-001 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

#### 11、海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

电话：021-23219275

传真：021-23219100

客户服务电话：021-95553、400-8888-001 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

#### 12、华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：李工

联系人：甘霖

电话：0551-65161666

传真：0551-5161600

客户服务电话：95318 或 4008096518

网址：[www.hazq.com](http://www.hazq.com)

#### 13、华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元

办公地址：上海市徐汇区肇嘉浜路 750 号

法定代表人：俞洋

联系人：杨莉娟

电话：021-54967552

传真：021-54967293

客户服务电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

网址：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

#### 14、江海证券有限公司

住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：刘爽

电话：0451-85863719

传真：0451-82287211

客户服务热线：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

15、联讯证券股份有限公司

住所：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

办公地址：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、  
四层

法定代表人：徐刚

联系人：陈思

电话：021-33606736

传真：021-33606760

客户服务电话：95564

网址：www.lxzq.com.cn

16、中泰证券股份有限公司

住所：济南市经七路 86 号

办公地址：济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客户服务电话：95538

网址：www.zts.com.cn

17、上海证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区西藏中路 336 号

办公地址：上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：龚德雄

联系人：张向纯

电话：021-53686888

传真：021-53686100，021-53686200

客户服务电话：021-962518

网址：www.962518.com

18、山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

客户服务电话：400-666-1618

网址：www.i618.com.cn

19、申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：曹晔

电话：021-33388215

传真：021-33388224

客户服务电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

20、五矿证券有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4028 号经贸中心 48 楼

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号经贸中心 48 楼

法定代表人：赵立功

联系人：马国栋

电话：0755-83252843

传真：0755-82545500

客户服务电话：40018-40028

网址：[www.wkzq.com.cn](http://www.wkzq.com.cn)

21、招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林迎生

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客户服务电话：95565、4008888111

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

22、中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

联系人：宋明

电话：010-66568450

传真：010-66568990

客户服务电话：400-888-8888

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

23、中山证券有限责任公司

住所：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

办公地址：深圳市华侨城深南大道 9010 号

法定代表人：黄扬录

联系人：罗艺琳

电话：0755- 82570586

传真：0755-82960582

客户服务电话：95329

网址：[www.zszq.com](http://www.zszq.com)



24、中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

电话：010-85130588

传真：010-65182261

客户服务电话：400-8888-108

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

25、中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层，266071

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务电话：95548

网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

26、中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京朝阳区亮马桥路 48 号

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-60838888

传真：010-60833799

客户服务电话：95548

网址：[www.ecitic.com](http://www.ecitic.com)

27、中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：洪诚

电话：0755-23953913

传真：0755-83217421

客户服务电话：400-990-8826

网址：[www.citicsf.com](http://www.citicsf.com)

28、嘉实财富管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 46 层 4609-10 单元

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人：赵学军

联系人：余永键

电话：010-85097570

传真：010-85097308

客户服务电话：400-021-8850

网址：[www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn)

29、上海中正达广投资管理有限公司

住所：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

联系人：戴珉微

电话：021-33768132

传真：021-33768132\*802

客户服务电话：400-6767-523

网址：[www.zzwealth.cn](http://www.zzwealth.cn)

30、中国国际金融股份有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇

电话：010-65051166

传真：010-85679203

客户服务电话：400-910-1166

网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

31、平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层（518048）

法定代表人：谢永林

联系人：周一涵

电话：021-38637436

传真：021-58991896

客户服务电话：95511-8

网址：[stock.pingan.com](http://stock.pingan.com)

32、奕丰金融服务（深圳）有限公司

住所（注册地址）：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海

商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115 室，1116 室及 1307 室

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：陈广浩

电话：0755- 89460506

传真：0755-21674453

客户服务电话：400-684-0500

网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

33、东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12、15 层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555147

客户服务电话：400-888-8993

网址：[www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

34、国金证券股份有限公司

住所：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

传真：028-86690126

客户服务电话：95310

网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

35、深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23A

法定代表人：高锋

联系人：李勇

电话：0755-83655588

传真：0755-83655518

客户服务电话：400-804-8688

网址：[www.keynesasset.com](http://www.keynesasset.com)

36、武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第 7 栋  
23 层 1 号、4 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第 7  
栋 23 层 1 号、4 号

法定代表人：陶捷

联系人：孔繁

电话：027-87006003\*8020

传真：027-87006010

客户服务电话：400-027-9899

网址：[www.buyfunds.cn](http://www.buyfunds.cn)

37、济安财富（北京）资本管理有限公司

住所：北京市朝阳区东三环中路 7 号 4 号楼 40 层 4601 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心 A 座 46 层

联系人：李海燕

电话：010-65309516

传真：010-65330699

客服电话：400-673-7010

网址：[www.jianfortune.com](http://www.jianfortune.com)

38、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

传真：0571-26698533

客户服务电话：400 076 6123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

## 39、深圳众禄金融控股股份有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

客户服务电话：400 678 8887

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

## 40、上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-20613999

传真：021-68596916

客户服务电话：400 700 9665

网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

## 41、上海天天基金销售有限公司

住所：浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

联系人：彭远芳

电话：021-54509998-2010

传真：021-64385308

客户服务电话：400 1818 188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

## 42、北京展恒基金销售股份有限公司

住所:北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层  
办公地址: 北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层  
法定代表人: 闫振杰  
联系人: 宋丽冉  
电话: 010-62020088  
传真: 010-62020355  
客户服务电话: 400 888 6661  
网址: <http://www.myfund.com>

43、北京钱景基金销售有限公司

住所:北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012  
办公地址: 北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012  
法定代表人: 赵荣春  
联系人: 申泽灏电话: 010-57418813  
传真: 010-57569671  
客服电话: 400 678 5095  
网址: [www.niuji.net](http://www.niuji.net)

44、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所:深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#  
办公地址:北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼东翼 7 层 727

室

法定代表人: 杨懿  
联系人: 张燕  
电话: 010-58325388-1588  
传真: 010-58325282  
客服电话: 400-166-1188  
网址: [https:// 8.jrj.com.cn](https://8.jrj.com.cn)

45、浙江同花顺基金销售有限公司

住所: 杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

法定代表人：凌顺平

联系人：刘晓倩

联系电话：0571-88911818

传真：0571-88910240

客服电话：4008-773-772

网址：www.5ifund.com

46、上海利得基金销售有限公司

住所：上海宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

联系人：赵沛然

电话：021-50583533

传真：021-50583633

客服电话：400-921-7755

网址：www.leadfund.com.cn

47、北京恒天明泽基金销售有限公司

住所：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

联系人：马鹏程

联系电话：13501068175

传真：010-56810628

客服：4008980618

网址：www.chtfund.com

48、上海陆金所资产管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼



法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

联系电话：021-20665952

传真：021-22066653

客服：4008219031

网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

49、北京虹点基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：胡伟

联系人：牛亚楠

联系电话：010-65951887

传真：010-65951887

客服：400-618-0707

网址：<http://www.hongdianfund.com/>

50、上海汇付金融服务有限公司

住所：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

联系人：陈云卉

联系电话：021-33323999-5611

传真：021-33323837

客服：400-820-2819

网址：<http://www.chinapnr.com/>

51、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼

法定代表人：汪静波

联系人：李娟

联系电话：021-38509735

传真：021-38509777

客服：400-821-5399

网址：<http://www.noah-fund.com/>

52、上海凯石财富基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：葛佳蕊

联系电话：021-63333389

传真：021-63332523

客服：4000178000

网址：[www.lingxianfund.com](http://www.lingxianfund.com)

53、珠海盈米财富管理有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：钟琛

联系电话：020-89629012

传真：020-89629011

54、大泰金石基金销售有限公司

住所：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

联系人：朱海涛

联系电话：021-20324158

传真：021-20324199

55、海银基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

办公地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 6 楼

法定代表人：刘惠

联系人：毛林

联系电话：021-80133597

传真：021-80133413

客服电话：400-808-1016

网址：[www.fundhaiyin.com](http://www.fundhaiyin.com)

56、上海联泰资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

联系电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：4000-466-788

网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

57、北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

联系电话：010-56282140

传真：010-62680827

客服电话：400-619-9059

网址：[www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

58、凤凰金信（银川）投资管理有限公司

住所：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402

办公用房

办公地址：北京市朝阳区来广营中街甲 1 号 朝来高科技产业园 5 号楼

法定代表人：程刚

联系人：张旭

联系电话：010-58160168

传真：010-58160181

客服：400-810-5919

网址：www.fengfd.com

59、乾道金融信息服务（北京）有限公司

住所：北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室

办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室

法定代表人：王兴吉

联系人：高雪超

联系电话：010-62062880

传真：010-82057741

客服：400-088-8080

网址：www.qiandaojr.com

60、深圳富济财富管理有限公司

住所：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室

法定代表人：齐小贺

联系人：马力佳

电话：0755-83999907-815

传真：0755-83999926

客户服务电话：0755-83999907

网址：www.jinqianwo.cn

61、北京肯特瑞财富投资管理有限公司

住所：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街十八号院京东集团总部

法定代表人：江卉

联系人：万容

电话：18910325400

传真：010-89189289

客户服务电话：个人业务：95118，400 098 8511 企业业务：400 088 8816

网址：<http://fund.jd.com/>

### （三）登记机构

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

法定代表人：崔伟

联系人：王骁骁

电话：010-66295873

传真：010-66578680

网址：[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com)

### （四）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系人：孙睿

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、孙睿

### （五）审计基金财产的会计师事务所

名称：立信会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市南京东路 61 号新黄浦金融大厦 4 层

办公地址：北京市海淀区西四环中路 16 号院 7 号楼 10 层

法定代表人：朱建弟

联系人：朱锦梅

电话：010-68286868

传真：010-88210608

经办注册会计师：朱锦梅、赵立卿

## 五、基金名称和基金类型

（一）本基金名称：东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金

（二）本基金类型：债券型基金

（三）基金运作方式：契约型, 开放式

## 六、基金的投资目标和投资方向

（一）基金的投资目标

本基金在积极投资、有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期、稳定增值，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。

（二）基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金主要投资于国债、地方政府债、中央银行票据、政策性金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、商业银行金融债与次级债、中小企业私募债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含分离交易的可转换债券）债券回购、银行存款等固定收益类资产。

本基金还可投资于股票和权证等权益类资产，可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证及因投资可分离债券而产生的权证等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，但在每个开放期前三个月、开放期间及开放期结束后三个月内，基金投资不受上述比例限制；股票等权益类资产占基金资产的比例不超过 20%，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%；开放期间，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受该比例限制。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人根据法律从法规的规定或在履行适当程序后对上述资产配置比例进行适当调整。

## 七、基金的投资策略

### （一）封闭期投资策略

#### 1、类别资产配置策略

本基金结合对我国股票市场、债券市场的发展特点、货币政策导向及宏观经济指标等分析，在符合本基金合同约定的前提下，确定对固定收益类资产和权益类资产的配置比例并进行动态调整。同时，本基金根据债券的发行主体、风险来源、收益率水平、市场流动性等因素，将债券市场划分为一般债券（含国债、中央银行票据、政策性金融债等）信用债券（公司债、企业债、金融债（不含政策性金融债）资产支持证券、短期融资券、证券公司短期公司债券、中小企业私募债券、中期票据等）附权债券（含可转换债券、分离交易可转换债券、含回售及赎回选择权的债券等）三个类别。

通过对债券市场预期风险水平及相对收益率、类别券种的流动性、信用水平等分析，确定基金资产在上述三个类别券种的配置比例。

#### （1）信用债券投资策略

信用债券的信用利差与债券发行人所在行业特征和自身情况密切相关。本基金将通过分析债券发行人所属行业及公司资产负债情况、公司现金流情况、公司运营情况及未来发展前景分析等，对信用债券的违约风险及合理的信用利差水平进行判断，对信用债券进行独立、客观的价值评估。

## （2）可转换债券投资策略

本基金在分析宏观经济运行特征和证券市场趋势判断的前提下，在综合分析可转换债券的债性特征、股性特征等因素的基础上，选择其中安全边际较高、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种进行投资。结合行业分析和个券选择，对成长前景较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注，选择投资价值较高的个券进行投资。

## （3）中小企业私募债券投资策略

本基金对中小企业私募债投资，主要通过期限和品种的分散投资控制流动性风险。以买入持有到期为主要策略，审慎投资。

针对内嵌转股选择权的中小企业私募债，本基金通过深入的基本面分析及定性定量研究，自下而上精选个债，在控制风险的前提下，谋求内嵌转股权潜在的增强收益。

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制订严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

## （4）证券公司短期公司债券投资策略

本基金将通过对证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究，分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平，对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。

基金投资证券公司短期公司债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

## 2、久期调整策略

在全面分析宏观经济环境与政策趋向等因素的基础上，本基金将通过调整债券资产组合的久期，达到增加收益或减少损失的目的。当预期市场总体利率水平降低时，本基金将延长所持有的债券组合的久期，从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升所产生的资本利得；反之，当预期市场总体利率水平上升时，则缩短组合久期，以避免债券价格下降的风险带来的资本损失，并获得较高的再投资收益。



### 3、期限结构策略

在债券资产久期确定的基础上，本基金将通过对债券市场收益率曲线形状变化的合理预期，调整组合的期限结构策略，适当的采取子弹策略、哑铃策略、梯式策略等，在短期、中期、长期债券间进行配置，以从短、中、长期债券的相对价格变化中获取收益。当预期收益率曲线变陡时，采取子弹策略；当预期收益率曲线变平时，采取哑铃策略；当预期收益率曲线不变或平行移动时，采取梯形策略。

### 4、股票投资策略

本基金可适当投资于股票，增强基金资产收益。本基金股票投资部分将重点投资于成长性好、估值水平具有一定安全边际的股票，同时参考公司的历史分红情况和分红能力。本基金将全面考察公司所处行业的产业竞争格局、业务发展模式、盈利增长模式、公司治理结构等基本面特征对公司的投资价值进行分析和比较，挖掘具备投资价值的股票。

### 5、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

### 6、其他金融工具的投资策略

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他衍生金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。本基金将在有效风险管理的前提下，通过对标的品种的基本面研究，结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险对冲比例，谨慎投资。

#### （二）开放期投资策略

开放期内，本基金为保持较高的流动性，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，主要配置高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。

## 八、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：同期三年期银行定期存款基准利率×1.5

本基金的投资目标是为投资者提供长期稳定的保值增值，本业绩比较基准可以较好地反映本基金的投资目标。若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，由基金管理人报中国证监会备案并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

法律法规另有规定的，从其规定。

## 九、基金的风险收益特征

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。

## 十、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本投资组合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。

基金托管人根据本基金合同规定，已复核了本投资组合报告中的财务指标、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。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

### 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	410,913.20	0.19
	其中：股票	410,913.20	0.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	81,989,430.00	38.81
	其中：债券	81,989,430.00	38.81
	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	109,010,360.00	51.61
	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	18,126,669.04	8.58
8	其他资产	1,701,732.86	0.81
9	合计	211,239,105.10	100.00

2、. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	204,923.20	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	49,300.00	0.02
E	建筑业	156,690.00	0.07
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
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	410,913.20	0.20

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	600967	北方创业	10,000	151,300.00	0.07

2	600820	隧道股份	10,000	104,500.00	0.05
3	600435	北方导航	3,000	50,580.00	0.02
4	601991	大唐发电	10,000	49,300.00	0.02
5	601611	中国核建	2,000	34,280.00	0.02
6	601800	中国交建	1,000	17,910.00	0.01
7	000651	格力电器	96	3,043.20	0.00
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	50,839,000.00	24.19
5	企业短期融资券	29,957,000.00	14.26
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,193,430.00	0.57
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	81,989,430.00	39.02

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	1580225	15 武夷新区债	150,000	15,144,000.00	7.21
2	1080113	10 苏海发债	150,000	15,120,000.00	7.20
3	1280470	12 黄岩国资债	200,000	10,220,000.00	4.86
4	011698525	16 盾安 SCP003	100,000	9,992,000.00	4.76
5	011698938	16 恒逸 SCP005	100,000	9,986,000.00	4.75

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

本报告期末未持有资产支持证券。

7、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。

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。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

10、投资组合报告附注

（1）本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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、处罚的情形。

（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。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	91,578.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,610,154.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,701,732.86

（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	113008	电气转债	114,430.00	0.05

（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

## 十一、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（1）基金的净值表现

本期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

东方永润债券 A 类

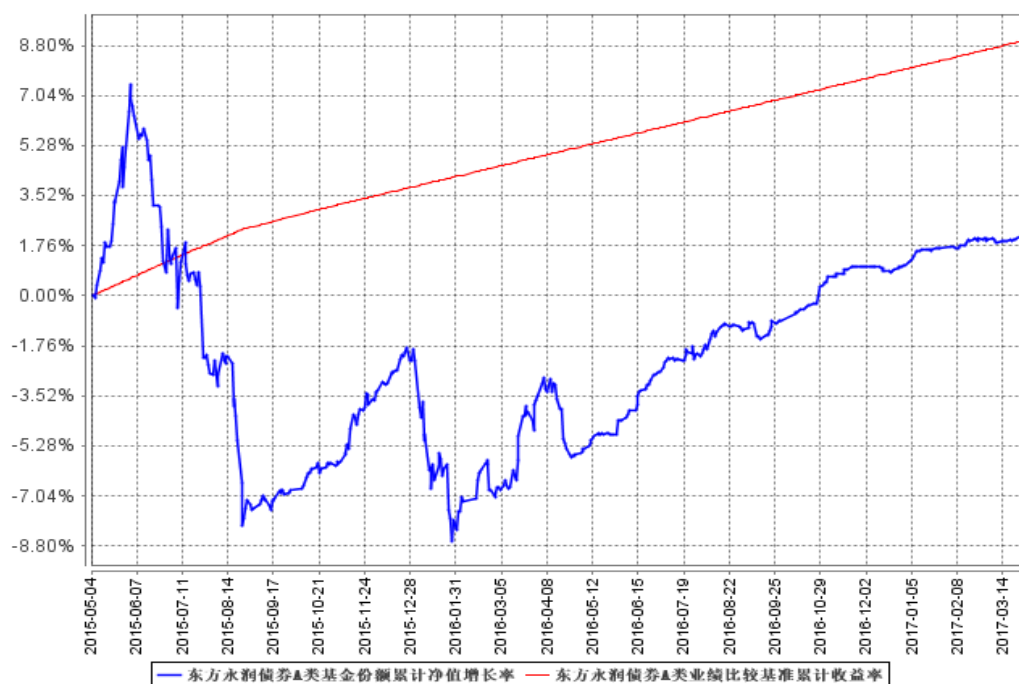
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015. 5. 4-2015. 12. 31	-2. 30%	0. 53%	3. 85%	0. 01%	-6. 15%	0. 52%
2016. 1. 1-2016. 12. 31	3. 46%	0. 33%	4. 13%	0. 01%	-0. 67%	0. 32%
2017. 1. 1-2017. 3. 31	1. 02%	0. 04%	1. 02%	0. 00%	0. 00%	0. 04%

东方永润债券 C 类

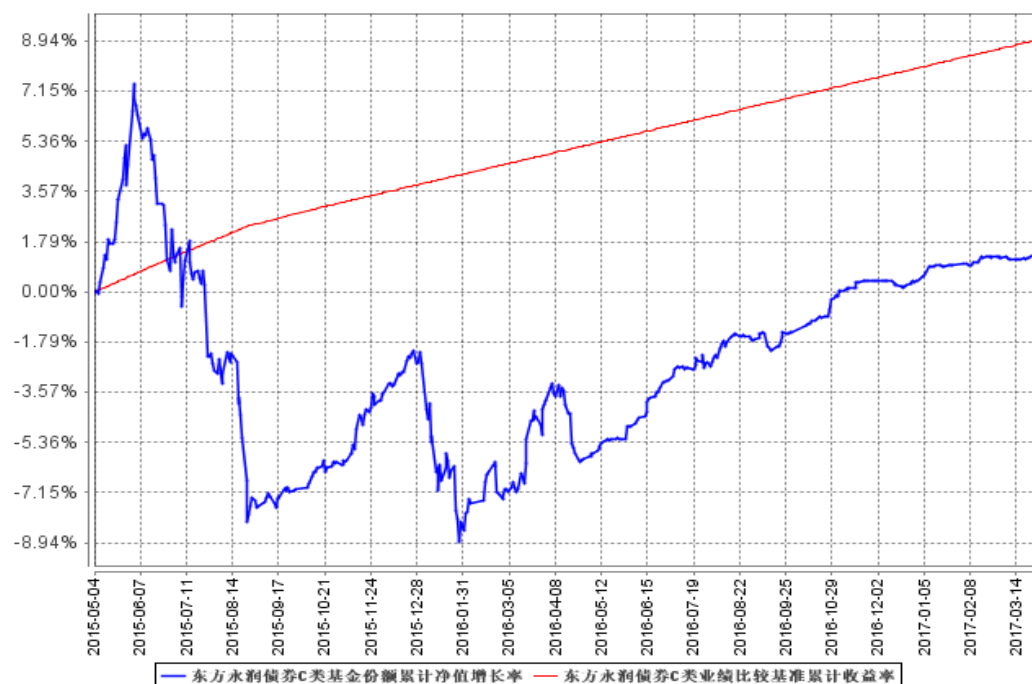
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015. 5. 4-2015. 12. 31	-2. 56%	0. 53%	3. 85%	0. 01%	-6. 41%	0. 52%
2016. 1. 1-2016. 12. 31	3. 05%	0. 33%	4. 13%	0. 01%	-1. 08%	0. 32%
2017. 1. 1-2017. 3. 31	0. 93%	0. 04%	1. 02%	0. 00%	-0. 09%	0. 04%

(2) 本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

东方永润债券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



东方永润债券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



## 十二、费用概览

### （一）管理费率：

本基金的管理费每日按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。

### （二）托管费率：

本基金的托管费每日按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。

### （三）C 类基金份额销售服务费

本基金仅对 C 类基金份额收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费每日按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

## 十三、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定以及《东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动

进行了更新，主要内容如下：

（一）在“重要提示”中,对“招募说明书有关财务数据的截止日期”及“其他内容的截止日期”进行了更新。

（二）在“第三部分 基金管理人”，对基金管理人的相关内容进行了更新。

（三）在“第四部分 基金托管人”，更新了基金托管人的相关内容。

（四）在“第五部分 相关服务机构”，更新了其他销售机构的信息。

（五）在“第八部分 基金的投资”，更新了“基金的投资组合报告”的内容，截止日期为 2017 年 3 月 31 日，该部分内容均按有关规定编制，并经本基金托管人复核，但未经审计。对“投资管理流程”相关内容进行了更新。

（六）在“第九部分 基金的业绩”，该部分内容均按照有关规定编制，并经本基金托管人复核，但相关财务数据未经审计。

（七）在“第二十一部分 其他应披露事项”，更新了从上一次招募说明书（更新）截止日 2016 年 11 月 4 日，至本次招募说明书（更新）截止日 2017 年 5 月 4 日之间的信息披露事项。

上述内容仅为本基金更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书详细内容，可登录东方基金管理有限责任公司网站 [www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)。

东方基金管理有限责任公司

2017 年 6 月