

东方策略成长混合型开放式证券投资基金  
招募说明书（更新）  
（2018 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：中国建设银行股份有限公司

## 重要提示

东方策略成长混合型开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)根据2008年3月21日中国证券监督管理委员会《关于核准东方策略成长股票型开放式证券投资基金募集的批复》(证监许可[2008]407号)和《关于同意东方策略成长股票型开放式证券投资基金募集时间安排的函》(基金部函[2008]121号)的核准募集。本基金基金合同于2008年6月3日正式生效。

基金管理人保证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审核同意,但中国证监会对本基金作出的任何决定,均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。

本基金投资于证券市场,基金份额净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险,投资者在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同,全面认识本基金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,并对认购(或申购)本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险,包括市场风险、管理风险、流动性风险和本基金所投资的股票、债券、衍生品等各种投资工具的相关风险等。在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行承担。

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新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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金管理人于2015年8月7日在基金管理人网站发布《关于东方策略成长股票型开放式证券投资基金变更基金名称并修改基金合同的公告》,决定不变更本基金的股票投资比例,将本基金的类别变更为混合型,基金名称变更为“东方策略成长混合型开放式证券投资基金”,基金简称变更为“东方策略成长混合”,基金代码不变。基金管理人于2015年8月7日在基金管理人网站对更名后的基金合同、托管协议进行了披露。上述文件可通过本基金管理人网站查阅。

基金管理人于2015年8月10日在基金管理人网站发布《关于变更东方策略成长混合型开放式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“中信标普 300 指数收益率×70%+中信标普全债指数收益率×30%”变更为“中信标普 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%”，并且修改基金合同相应条款。基金管理人于 2015 年 8 月 10 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 2015 年 11 月 4 日在基金管理人网站发布《东方基金管理有限责任公司关于旗下部分基金业绩比较基准名称变更并修改基金合同的公告》，决定将本基金的业绩比较基准进行更名，由“中信标普 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%”更名为“标普中国 A 股 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%”，基金管理人于 2015 年 11 月 4 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。

根据中国证监会 2017 年 10 月 1 日起施行的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求，经与相关基金托管人协商一致，并报监管部门备案后，本基金管理人旗下部分基金的基金合同及托管协议进行了修订，修订后的基金合同及托管协议自 2018 年 3 月 31 日起生效，具体情况请参阅本基金管理人于 2018 年 3 月 31 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及本基金管理人网站上发布的公告。

有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 3 月 31 日（财务数据未经审计），本招募说明书其他所载内容截止日为 2018 年 6 月 3 日。

## 目 录

第一部分 绪言 .....	1
第二部分 释义 .....	2
第三部分 基金管理人 .....	7
第四部分 基金托管人 .....	19
第五部分 相关服务机构 .....	23
第六部分 基金的募集与基金合同的生效 .....	53
第七部分 基金份额的申购与赎回 .....	54
第八部分 基金的投资 .....	64
第九部分 基金的业绩 .....	80
第十部分 基金的财产 .....	82
第十一部分 基金资产的估值 .....	83
第十二部分 基金的收益与分配 .....	89
第十三部分 基金的费用与税收 .....	91
第十四部分 基金的会计与审计 .....	93
第十五部分 基金的信息披露 .....	94
第十六部分 风险揭示 .....	99
第十七部分 基金合同的终止与基金财产的清算 .....	102
第十八部分 基金合同内容摘要 .....	104
第十九部分 基金托管协议内容摘要 .....	120
第二十部分 对基金份额持有人的服务 .....	130
第二十一部分 其他应披露事项 .....	133
第二十二部分 招募说明书的存放及查阅方式 .....	135
第二十三部分 备查文件 .....	136

## 第一部分 绪言

本《招募说明书》依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他相关法律法规的规定以及《东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

基金管理人承诺本《招募说明书》不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本《招募说明书》所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本《招募说明书》中载明的信息,或对本《招募说明书》作任何解释或者说明。

本《招募说明书》根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

在本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指东方策略成长混合型开放式证券投资基金
- 2、基金管理人或本基金管理人：指东方基金管理有限责任公司
- 3、基金托管人或本基金托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4、基金合同或本基金合同：指《东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《东方策略成长混合型开放式证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书：指《东方策略成长混合型开放式证券投资基金招募说明书》，招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件，自基金合同生效之日起，每6个月更新1次，并于每6个月结束之日后的45日内公告，更新内容截至每6个月的最后1日
- 7、基金份额发售公告：指《东方策略成长混合型开放式证券投资基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过，自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指2013年2月17日经中国证券监督管理委员会第28次主席办公会议通过，自2013年6月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会2004年6月8日颁布并于2004年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及不时作出的修订
- 12、《运作办法》：指2014年7月7日由中国证监会公布并于2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订

13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

16、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定或中国证监会批准可投资于证券投资基金的自然人

18、机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》规定的条件，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构

20、投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的合称

21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资者

22、基金销售业务：指基金的认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

23、销售机构：指直销机构和其他销售机构

24、直销机构：指东方基金管理有限责任公司

25、其他销售机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

26、会员单位：指具有开放式基金销售资格，经上海证券交易所和中国证券

登记结算有限责任公司认可的、可通过上海证券交易所交易系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的上海证券交易所会员单位

27、基金销售网点：指直销机构的直销中心及其他销售机构的销售网点

28、份额登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容  
包括投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、  
清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

29、份额登记机构：指办理份额登记业务的机构。基金的份额登记机构为东  
方基金管理有限责任公司或接受东方基金管理有限责任公司委托代为办理份额登  
记业务的机构

30、基金账户：指份额登记机构为投资者开立的、记录其持有的、基金管理  
人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

31、基金交易账户：指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机  
构买卖本基金份额的变动及结余情况的账户

32、基金合同生效日：指基金募集达到法律规定及基金合同规定的条件，基  
金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日  
期

33、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财  
产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

34、基金募集期限：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最  
长不得超过3个月

35、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

36、日/天：指公历日

37、月：指公历月

38、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

39、T日：指本基金在规定时间受理投资者申购、赎回或其他业务申请的日期

40、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

41、开放日：指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

42、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段，具体时



间见基金份额发售公告

43、《开放式基金业务规则》：指《东方基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人和投资者共同遵守

44、认购：指在基金募集期间，投资者申请购买基金份额的行为

45、申购：指基金合同生效后，投资者根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

46、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回基金份额的行为

47、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效的公告在本基金份额与基金管理人管理的其他基金份额间的转换行为

48、转托管：指基金份额持有人在同一基金的不同销售机构之间实施的所持基金份额销售机构变更的操作

49、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的10%

50、元：指人民币元

51、定期定额投资计划：指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

52、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入、证券持有期间产生的公允价值变动及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

53、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

54、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

55、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数

56、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

57、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

58、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

59、不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

## 第三部分 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

成立日期：2004 年 6 月 11 日

组织形式：有限责任公司

注册资本：叁亿元人民币

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	19,200 万元	64%
河北省国有资产控股运营有限公司	8,100 万元	27%
渤海国际信托股份有限公司	2,700 万元	9%
合 计	30,000 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、研究部、固定收益部、量化投资部、电子商务部、专户投资部、产品开发部、机构业务一部、机构业务二部、市场部、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

九个职能部门及北京分公司、上海分公司、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风险管理和监察稽核工作。

## 二、基金管理人主要人员情况

### (一) 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，中国证监会党组书记、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监事、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副董事长、总裁、党委副书记，兼任吉林省证券业协会副会长，东证融通投资管理有限公司董事长，东证融达投资有限公司董事，东证融汇证券资产管理有限公司董事。

庄立明先生，董事，大学学历，会计师。历任河北省商业厅审计处，河北华

联商厦分店副经理, 省贸易厅财审处, 省商贸集团财审处(正科), 省工贸资产经营有限公司财务监督处副处长, 河北省国有资产控股运营有限公司财务监督部副部长、财务监督部部长、副总会计师; 现任河北省国有资产控股运营有限公司董事、总会计师, 兼任财达证券有限责任公司董事, 华联发展集团有限公司董事。

董丁丁先生, 董事, 北京大学金融学硕士, 中共党员。历任海南航空股份有限公司飞行计划员、机组资源管理员、海航集团财务有限公司金融服务部信贷信息助理、信贷信息主管、公司业务经理、客户经理、总经理助理, 资金信贷部副总经理、总经理。现任渤海国际信托股份有限公司财务总监。

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, 三角轮胎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。

## (二) 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余年金融、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总经理。

## (三) 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，兼任东方汇智资产管理有限公司董事，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，曾任财务主管，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。

## (四) 本基金基金经理

姓名	任职时间	简历
王然 (女士)	2015年5月4日 至今	北京交通大学产业经济学硕士，10年证券从业经历，曾任益民基金交通运输、纺织服装、轻工制造行业研究

		<p>员。2010年4月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究员，东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于2015年8月7日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理助理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于2015年8月7日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金（于2017年5月11日转型为东方成长收益平衡混合型证券投资基金）基金经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金（于2017年9月13日起转型为东方民丰回报赢安混合型证券投资基金）基金经理、东方成长收益平衡混合型证券投资基金（于2018年1月17日转型为东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金）基金经理，现任东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理、东方新思路灵活配置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、东方合家保本混合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、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方大健康混合型证券投资基金基金经理。</p>
郭瑞 (先生)		2016年8月16日至2017年9月13日任本基金基金经理
张洪建 (先生)		2014年12月15日至2016年7月1日任本基金基金经理
于鑫 (先生)		2008年6月3日至2015年1月1日任本基金基金经理

付勇 (先生)	2008年6月3日至2010年2月12日任本基金基金经理
------------	------------------------------

#### (五) 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。

彭成军先生，公司总经理助理兼固定收益投资总监，投资决策委员会委员，清华大学数学硕士，11年投资从业经历。曾任中国光大银行交易员，中国民生银行金融市场部投资管理中心总经理助理、高级交易员。2017年11月加盟东方基金管理有限责任公司。现任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。

蒋茜先生，研究部总经理，投资决策委员会委员。清华大学工商管理硕士，8年证券从业经历。历任 GCW Consulting 高级分析师、中信证券高级经理、天安财产保险股份有限公司研究总监、渤海人寿保险股份有限公司投资总监。2017年5月加盟东方基金管理有限责任公司。现任东方支柱产业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。

刘志刚先生，量化投资部总经理，投资决策委员会委员，吉林大学数量经济学博士，10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。现任东方启明量化先锋混合型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、东方岳灵活配置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、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

朱晓栋先生，权益投资部副总经理，投资决策委员会委员，对外经济贸易大学经济学硕士，9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



转型为东方核心动力混合型证券投资基金)基金经理、东方区域发展混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理。现任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、东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

姚航女士,固定收益部副总经理,投资决策委员会委员,中国人民大学工商管理硕士,14年证券从业经历。曾就职于嘉实基金管理有限公司运营部。2010年10月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任债券交易员、东方金账簿货币市场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、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金(于2017年5月11日起转型为东方成长收益平衡混合型证券投资基金)基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金(于2017年9月13日起转型为东方民丰回报赢安混合型证券投资基金)基金经理、东方成长收益平衡混合型证券投资基金(于2018年1月17日转型为东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金)基金经理、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任东方金账簿货币市场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、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方金元宝货币市场基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理。

(六)上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人职责

- 1、依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
- 2、办理基金备案手续;
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账,进行证券投资;

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

6、编制季度、半年度和年度基金报告;

7、计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项;

9、召集基金份额持有人大会;

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

11、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

12、有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

#### 四、基金管理人的承诺

(一) 本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

(二) 本基金管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》及有关法律法规,建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止下列行为发生:

(1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

(2) 不公平地对待其管理的不同基金财产;

(3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益;

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

(三) 本基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动:

(1) 越权或违规经营;

(2) 违反基金合同或托管协议;

(3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益;

- (4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;
- (6) 玩忽职守、滥用职权;
- (7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定, 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密, 尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;
- (8) 违反证券交易场所业务规则, 利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格, 扰乱市场秩序;
- (9) 贬损同行, 以抬高自己;
- (10) 以不正当手段谋求业务发展;
- (11) 有悖社会公德, 损害证券投资基金人员形象;
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;
- (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### (四) 基金经理承诺

- 1、依照有关法律、法规和基金合同的规定, 本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;
- 2、不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益;
- 3、不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定, 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;
- 4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

### 五、基金管理人的内部控制制度

#### (一) 内部控制的原则

- 1、健全性原则: 内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员, 并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。
- 2、有效性原则: 通过科学的内控手段和方法, 建立合理的内控程序, 维护内部控制制度的有效执行。
- 3、独立性原则: 公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立, 基金资产、

自有资产、其他资产的运作应当分离。

4、相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

5、成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本,提高经济效益,以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## (二) 内部控制的主要内容

### 1、控制环境

(1) 控制环境构成公司内部控制的基础,环境控制包括管理思想、经营理念、控制文化、公司治理结构、组织结构和员工道德素质等内容。

(2) 管理层通过定期学习、讨论、检讨内控制度,组织内控设计并以身作则、积极执行,牢固树立诚实信用和内控优先的思想,自觉形成风险管理观念;通过营造公司内控文化氛围,增进员工风险防范意识,使其贯穿于公司各部分、岗位和业务环节。

(3) 董事会负责公司内部控制基本制度的制定和内控工作的评估审查,对公司建立有效的内部控制系统承担最终责任;同时,通过充分发挥独立董事和监事会的监督职能,避免不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生,建立健全符合现代企业制度要求的法人治理结构。

(4) 建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制,包括民主透明的决策程序和管理议事规则,高效严谨的业务执行系统,以及健全有效的内部监督和反馈系统。

(5) 建立科学的聘用、培训、轮岗、考评、晋升、淘汰等人事管理制度,严格制定单位业绩和个人工作表现挂钩的薪酬制度,确保公司职员具备和保持正直、诚实、公正、廉洁的品质与应有的专业能力。

### 2、风险评估

公司定期评估公司风险状况,范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素,评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性,并将评估报告报公司董事会及高级管理人员。

### 3、组织体系

内部控制组织体系包括三个层次:

第一层次：董事会层面对本公司经营管理过程中的风险控制工作的指导；

公司董事会通过其下设的合规与风险控制委员会、督察长对本公司和本基金的合法合规性进行监督。

合规与风险控制委员会代表董事会在董事会授权范围内对公司和基金运作的合法合规性及风险控制状况进行评估，并督促经理层、督察长落实或改进。

督察长根据法律、法规的规定，监督检查基金和公司运作的合法合规及公司内部风险控制情况，行使法律、法规及中国证监会和公司章程规定的职权。

第二层次：公司管理层对经营风险进行预防和控制的组织主要是总经理办公会、风险控制委员会和风险与监察稽核部门；

(1) 总经理办公会为公司经营重大事项之决策机构，并负责公司层面风险管理工作。

(2) 风险控制委员会是公司基金投资的最高风险控制机构。风险控制委员会的主要职权是拟定基金投资风险控制的基本制度和标准，划分和量化市场风险，并进行基金投资组合的风险评估和业绩评价。

(3) 风险与监察稽核部门，负责对公司、基金运作和资产管理的合法合规性、内部控制制度的有效性及公司日常风险和基金投资的绩效评价进行风险管理、监察、稽核。

第三层次：各职能部门对各自业务的自我检查和监控。

公司各业务部门作为公司内部风险控制的具体实施单位，在公司各项基本管理制度的基础上，根据具体情况制订和执行本部门的业务管理办法和操作流程，对各自业务中潜在风险进行自我检查和控制。

#### 4、制度体系

制度是内部控制的指引和规范，制度缜密是内部控制体系的基础。

(1) 内部控制制度包括内部管理控制制度、业务控制制度、会计核算控制制度、信息披露制度、监察稽核制度等。

(2) 内部管理控制制度包括授权管理制度、人力资源及业绩考核制度、行政管理制、员工行为规范、纪律程序。

(3) 业务控制制度包括投资管理制度、风险控制制度、资料档案管理制度、

技术保障制度和危机处理制度。

#### 5、信息与沟通

建立内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

#### (三) 基金管理人关于内部控制的声明

- 1、本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；
- 2、上述关于内部控制的披露真实、准确；
- 3、本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2017 年 6 月末，本集团资产总额 216,920.67 亿元，较上年末增加 7,283.62 亿元，增幅 3.47%。上半年，本集团实现利润总额 1,720.93 亿元，较上年同期增长 1.30%；净利润较上年同期增长 3.81%至 1,390.09 亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016 年，本集团先后获得国内外知名机构授予的 100 余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016 中国最佳银行”，《环球金融》“2016 中国最佳消费者银行”、“2016 亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016 年“世界银行 1000 强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第 2；在美国《财富》2016 年世界 500 强排名第 22 位。

中国建设银行总行设资产托管业务部, 下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室, 在上海设有投资托管服务上海备份中心, 共有员工 220 余人。自 2007 年起, 托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计, 并已经成为常规化的内控工作手段。

## (二) 主要人员情况

纪伟, 资产托管业务部总经理, 曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职, 并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历, 熟悉各项托管业务, 具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅, 资产托管业务部副总经理, 曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长, 长期从事信贷业务和集团客户业务等工作, 具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平, 资产托管业务部副总经理, 曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部, 长期从事客户服务、信贷业务管理等工作, 具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲, 资产托管业务部副总经理, 曾就职于中国建设银行总行会计部, 长期从事托管业务管理等工作, 具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玢, 资产托管业务部副总经理, 曾就职于中国建设银行总行国际业务部, 长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作, 具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## (三) 基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行, 中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念, 不断加强风险管理和内部控制, 严格履行托管人的各项职责, 切实维护资产持有人的合法权益, 为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展, 中国建设银行托管资产规模不断扩大, 托管业务品种不断增加, 已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系, 是目前国内托管



业务品种最齐全的商业银行之一。截至2017年二季度末,中国建设银行已托管759只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续11年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项,并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### (一) 内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

### (二) 内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作,具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### (三) 内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

## 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

### (一) 监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”,严格按照现行法律法规以及

基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

## (二) 监督流程

1. 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统,对各基金投资运作比例控制等情况进行监控,如发现投资异常情况,向基金管理人进行风险提示,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2. 收到基金管理人的划款指令后,对指令要素等内容进行核查。

3. 根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性等方面进行评价,报送中国证监会。

4. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、直销机构

#### (一) 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

办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 3 层

法定代表人：崔伟

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)

#### (二) 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、中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼长安兴融中心

法定代表人：田国立

客服电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

#### 2、北京银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

客服电话：95526

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

### 3、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

客服电话：400-88-96666(全国)、96666(吉林省)

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

### 4、交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客服电话：95559 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：[www.95559.com.cn](http://www.95559.com.cn)

### 5、中国工商银行股份有限公司

住所：中国北京复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

联系人：杨菲

电话：010-66107900

传真：010-66107914

客服电话：95588

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

### 6、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

客服电话:95568

网址:www.cmbc.com.cn

#### 7、中国农业银行股份有限公司

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人:周慕冰

客服电话:95599

网址:www.abchina.com

#### 8、中国银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号中国银行总行办公大楼

法定代表人:陈四清

客服电话:95566

网址:www.boc.cn

#### 9、中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所:北京市西城区金融大街3号

办公地址:北京市西城区金融大街3号

法定代表人:李国华

联系人:王瑛

传真:010-68858126

客服电话:95580

网址:www.psbc.com

#### 10、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

客服电话：95555

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

11、中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：李庆萍

客服电话：95558

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

12、安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

客服电话：4008001001

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

13、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：尤习贵

联系人：奚博宇

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服电话：95579 或 4008-888-999

网址: [www.95579.com](http://www.95579.com)

14、东北证券股份有限公司

住所: 长春市生态大街 6666 号

办公地址: 长春市生态大街 6666 号

法定代表人: 李福春

联系人: 安岩岩

电话: 0431-85096517

传真: 0431-85096795

客服电话: 95360

网址: [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

15、东方证券股份有限公司

住所: 上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

办公地址: 上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人: 王益民

联系人: 吴宇

电话: 021-63325888

传真: 021-63326173

客服电话: 021-962506 或 40088-88506

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

16、东海证券股份有限公司

住所: 江苏省常州延陵西路 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: 赵俊

联系人: 王一彦

电话: 021-20333333

传真: 021-50498825

客服电话: 95531; 400-8888-588

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

17、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

客服电话：961130（省内直拨，省外请加拨区号 0769）

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

18、方正证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

联系人：郭军瑞

电话：0731-85832503

传真：0731-85832214

客服电话：95571

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

19、光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号 3 楼

法定代表人：周健男

联系人：戴巧燕

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客服电话：95525

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

20、广发证券股份有限公司

住所：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室



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

客服电话：95575

网址：www.gf.com.cn

21、国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客服电话：95521

网址：www.gtja.com

22、国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周杨

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客服电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

23、国元证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市寿春路 178 号

办公地址: 安徽省合肥市寿春路 178 号

法定代表人: 蔡咏

联系人: 李蔡

电话: 0551-68167423

传真: 0551-68167431

客服电话: 95578

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

24、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

客服电话: 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)

25、恒泰证券股份有限公司

住所: 内蒙古呼和浩特新城区新华东街 111 号

办公地址: 内蒙古呼和浩特新城区新华东街 111 号

法定代表人: 庞介民

联系人: 罗俊峰

电话: 0471-4972042

传真: 0471-4961259

客服电话: 0471-4961259

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

26、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：章宏韬

联系人：范超

电话：0551-65161666

传真：0551-5161600

客服电话：95318

网址：www.hazq.com

27、华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

客服电话：96326（福建省外请先拨0591）

网址：www.hfzq.com.cn

28、华泰证券股份有限公司

住所：江苏省南京市江东中路228号

办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道4011号港中旅大厦18楼

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962

客服电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

29、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

客服电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

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

### 30、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：哈尔滨市松北区创新三路833号

法定代表人：孙名扬

联系人：姜志伟

电话：0451-87765732

传真：0451-82337279

客户服务热线：400-666-2288

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

### 31、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：深圳市福田区深南中路2002号中广核大厦北楼10层

法定代表人：徐刚

联系人：彭莲

电话：0755-83331195

客服电话：95564

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

### 32、中泰证券股份有限公司

住所：济南市市中区经七路86号

办公地址：山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

电话: 021-20315290

传真: 021-20315125

客服电话: 95538

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

### 33、上海证券有限责任公司

住所: 上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址: 上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人: 李俊杰

联系人: 邵珍珍

电话: 021-53686888

传真: 021-53686100, 021-53686200

客服电话: 021-962518

网址: [www.962518.com](http://www.962518.com)

### 34、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

客服电话: 400-666-1618

网址: [www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

### 35、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: 王叔胤

电话: 021-33388252

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

36、申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼

法定代表人：韩志谦

联系人：王叔胤

电话：021-33388252

传真：021-33388224

客服电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

37、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

客服电话：40018-40028

网址：www.wkzq.com.cn

38、兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路268号

办公地址：上海市浦东新区长柳路36号

法定代表人：杨华辉

联系人：乔琳雪

电话: 021-38565547

客服电话: 95562

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

#### 39、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: 霍达

联系人: 黄婵君

电话: 0755-82943666

传真: 0755-829734343

客服电话: 95565、4008888111

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

#### 40、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

客服电话: 400-888-8888

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

#### 41、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: 深圳市福田区莲花街道益田路 6013 号江苏大厦 B 座 15 楼

法定代表人: 黄扬录

联系人: 罗艺琳

电话: 0755-82570586

传真: 0755-82960582

客服电话：95329

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

#### 42、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

客服电话：400-8888-108

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

#### 43、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1号楼2001

办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

法定代表人：姜晓林

联系人：刘晓明

电话：0531-89606165

传真：0532-85022605

客服电话：95548

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

#### 44、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：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：郑慧

电话：010-6083 8888

传真：010-6083 6029

客服电话：95548



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

45、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

客服电话: 400-990-8826

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

46、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

客服电话: 400-910-1166

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

47、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: 刘世安

联系人: 周一涵

电话: 021-38637436

传真: 021-58991896

客服电话：95511-8

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

48、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：夏锐

电话：010-66559079

传真：010-66555147

客服电话：95309

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

49、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

客服电话：95310

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

50、中国民族证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区北四环中路27号5号楼

办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号5号楼

法定代表人：何亚刚

联系人：尚蓓

电话：010-59355497

传真：010-56437030

客服电话：400-889-5618

网址: [www.e5618.com](http://www.e5618.com)

51、上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所: 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址: 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人: 张跃伟

联系人: 单丙焱

电话: 021-20691832

传真: 021-20691861

客户服务电话: 400 820 2899

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

52、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)

53、深圳众禄基金销售股份有限公司

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)

54、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

55、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

56、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:www.myfund.com

57、中国国际期货有限公司

住所:北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 1 层、2 层、9 层、11 层、12

层

办公地址:北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层

法定代表人:王兵

联系人:许黎婧

电话:010-65807848

传真:010-59539806

客服电话:95162或400 888 8160

网址:www.cifco.net

58、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

59、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:8.jrj.com.cn

60、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](http://www.5ifund.com)

#### 61、北京增财基金销售有限公司

住所: 北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号

办公地址: 北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号

法定代表人: 罗细安

联系人: 史丽丽

电话: 010-67000988

传真: 010-67000988

客户服务电话: 400-001-8811

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

#### 62、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](http://www.leadfund.com.cn)

#### 63、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](http://www.chtfund.com)

#### 64、上海陆金所基金销售有限公司

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)

#### 65、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: [www.hongdianfund.com](http://www.hongdianfund.com)

#### 66、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：[www.chinapnr.com](http://www.chinapnr.com)

67、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：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

68、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)

69、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: 李孟军

联系电话: 020-89629012

传真: 020-89629011

70、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

客服电话: 400-928-2266

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

71、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)

72、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)

73、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)

74、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](http://www.fengfd.com)

75、乾道盈泰基金销售(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](http://www.qiandaojr.com)

76、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](http://www.jinqianwo.cn)

77、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: [fund.jd.com](http://fund.jd.com)

78、上海基煜基金销售有限公司

住所: 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人: 王翔

联系人: 李鑫

电话: 021-65370077

传真: 021-55085991

客户服务电话: 400-820-5369

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

79、一路财富(北京)信息科技股份有限公司

住所: 北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室

办公地址: 北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室

法定代表人: 吴雪秀

联系人: 徐越

电话: 010-88312877

传真: 010-88312099

客服电话: 400-001-1566

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

80、上海华夏财富投资管理有限公司

住所: 上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

办公地址: 北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人: 毛淮平

联系人: 仲秋玥

电话: 010-88066632

传真: 010-63136184

客户服务电话: 400-817-5666

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

81、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)

82、上海中正达广基金销售有限公司

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)

83、奕丰金融服务(深圳)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: 深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人: TEO WEE HOWE

联系人: 叶健

电话: 0755-89460507

传真: 0755-21674453

客户服务电话: 400-684-0500

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

84、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)

85、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)

86、济安财富(北京)基金销售有限公司

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)

87、金惠家保险代理有限公司

住所: 北京市海淀区东升园公寓 1 号楼 1 层南部

办公地址: 北京市朝阳区门外大街 18 号丰联广场 A 座 1009

联系人: 胡明哲

电话: 15810201340

传真: 028-62825388

客服电话: 400-8557333

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

**88、和合期货有限公司**

住所：山西省太原市迎泽区菜园东街2号

办公地址：山西省太原市迎泽区菜园东街2号

联系人：张基甲

电话：0351-7342798

传真：0351-7342538

客服电话：0351-7342798

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

**89、天津市凤凰财富基金销售有限公司**

住所：天津市和平区南京路181号世纪都会1606-1607

办公地址：天津市和平区南京路181号世纪都会1606-1607

联系人：孟媛媛

电话：18920017760

传真：022-23297867

客户服务电话：400-706-6880

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

**三、份额登记机构**

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：刘博睿

电话：010-66295824

传真：010-66578680

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

**四、律师事务所和经办律师**

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：韩炯

联系人：吕红

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：吕红 黎明

## 五、会计师事务所和经办注册会计师

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4楼

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



## 第六部分 基金的募集与基金合同的生效

一、本基金根据 2008 年 3 月 21 日中国证券监督管理委员会《关于同意东方策略成长股票型开放式证券投资基金募集的批复》(证监许可[2008]407 号)和《关于同意东方策略成长股票型开放式证券投资基金募集时间安排的函》(基金部函[2008]121 号)的核准,并按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定进行募集。

二、本基金类型:混合型

本基金运作方式:契约型、开放式

本基金存续期限:不定期

三、本基金募集期为:2008 年 4 月 15 日至 2008 年 5 月 30 日

募集份额为:329,260,029.20 份

有效户数为:7,660 户

四、本基金根据《关于东方策略成长股票型证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2008]225 号)的批准,于 2008 年 6 月 3 日基金合同生效。

本基金基金合同生效后,连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续六十个工作日出现上述情形的,基金管理人应向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规另有规定时,从其规定。

## 第七部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回办理场所

(一) 本基金管理人的直销机构为直销中心以及电子交易平台。

(二) 经本基金管理人委托,具有销售开放式基金资格的商业银行或其他机构的营业网点即其他销售机构销售网点。目前其他销售机构的名称、住所等信息请详见本招募说明书“第五部分 相关服务机构”中“(二) 其他销售机构”。本基金管理人可根据情况增减基金其他销售机构,并予以公告。

(三) 投资者可通过本基金直销机构或指定的其他销售机构按照规定的方式进行申购或赎回。

### 二、申购和赎回的办理时间

(一) 本基金办理日常申购和赎回的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日(本基金管理人公告暂停时除外)。具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。目前,上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间为交易日上午9:30-11:30,下午1:00-3:00。

(二) 若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他原因,基金管理人可对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整并于实施前在中国证监会指定媒体上公告。

(三) 投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的,其基金份额申购、赎回视为下一开放日的交易申请。

(四) 本基金自2008年6月18日开始正常申购;自2008年6月18日开始正常办理赎回。

### 三、申购与赎回的原则

(一) “未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算;

(二) “金额申购、份额赎回”原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请;

(三) 赎回遵循“先进先出”原则,即按照投资者申(认)购的先后次序进

行顺序赎回；

(四) 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

#### 四、申购和赎回的数额限定

(一) 申购金额的限制

每个账户首次申购的最低金额为 1.00 元人民币(如果投资者已通过认购交易持有本基金基金份额,则不受此限制。)追加申购的最低金额为 1.00 元人民币,超过 1.00 元的部分不设最低级差限制。当投资者选择红利再投资将所得现金红利转购基金份额或采用定期定额投资计划时,不受最低申购金额的限制。

(二) 赎回份额的限制

赎回的最低份额为 1 份基金份额。

基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回,但某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于 1 份时,基金管理人有权将剩余基金份额一次性全部赎回。

(三) 基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额上限,具体规定请参见更新的招募说明书。

(四) 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益,具体请参见相关公告。

(五) 基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整申购的金额和赎回的份额的数量限制,基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上刊登公告。

#### 五、申购和赎回的程序

(一) 申购和赎回的申请方式

投资者必须根据销售机构规定的程序，在开放日的交易时间内提出申购或赎回的申请。

投资者在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

## (二) 申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，并在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资者可在T+2日(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

## (三) 申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的其他销售机构将投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。

投资者赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

## 六、基金的申购费和赎回费

### (一) 申购费用

本基金的申购费用由申购人承担，不列入基金财产，申购费用用于本基金的市场推广和销售。

本基金的申购费采用前、后端收费模式，具体如下表所示：

前端收费费率如下：

申购金额(M)	费率
M<100万	1.5%
100万≤M<500万	1.2%
M≥500万	单笔1000元

后端收费费率如下：

持有期限	申购费率(F)
1年以内(含)	F=1.8%
1年—3年(含)	F=1.0%

3 年以上	F=0
-------	-----

最低申购金额：1.00 元

投资者选择红利再投资所转成的份额不收取申购费用。

(二) 赎回费用

赎回费用由基金赎回人承担，未归入基金资产的部分用于支付登记费和其他手续费等。

本基金的赎回费率如下：

持有期限	费率	计入基金财产比例
7 日以内	1.50%	100%
7 日(含) -1 年以内(含)	0.50%	25%
1 年—3 年(含)	0.25%	25%
3 年以上	0	--

(三) 基金管理人可以根据法律法规规定及基金合同调整申购费率和赎回费率, 最新的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。费率如发生变更, 基金管理人最迟应于新的费率开始实施 3 个工作日前在指定媒体上公告。

**七、申购和赎回的数额和价格**

(一) 申购和赎回数额、余额的处理方式

1、申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以申请当日基金份额净值为基准计算，保留小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金资产；

2、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以申请当日基金份额净值并扣除相应的费用，四舍五入保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

3、申购费、赎回费的处理方式：采用截位法，即：保留小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去。

(二) 申购份额的计算

1、前端收费模式：

$$\text{前端申购费用} = \{ \text{申购金额} / (1 + \text{前端申购费率}) \} * \text{前端申购费率}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{前端申购费用}$$

申购份额 = 净申购金额 / 申购日基金份额净值

前端申购费用在投资者申购基金时收取。

例一：某投资者投资 4 万元申购本基金，申购费率为 1.5%，假设申购当日基金份额净值为 1.0400 元，如果其选择前端收费方式，则其可得到的申购份额为：

前端申购费用 =  $\{40,000 / (1 + 1.5\%)\} * 1.5\% = 591.13$  元

净申购金额 =  $40,000 - 591.13 = 39,408.87$  元

申购份额 =  $39,408.87 / 1.0400 = 37,893.14$  份

2、后端收费模式：

申购份额 = 申购金额 / 申购日基金份额净值

后端申购费用 = 赎回份额 × 申购日基金份额净值 × 后端申购费率

后端申购费用在投资者赎回份额时收取。

例二：某投资者投资 4 万元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.0400 元，如果其选择后端收费方式，则其可得到的申购份额为：

申购份额 =  $40,000 / 1.0400 = 38,461.53$  份

(三) 赎回金额的计算

1、如果投资者在认(申)购时选择交纳前端申购费用，则赎回金额的计算方法如下：

赎回费用 = 赎回份额 × 赎回日基金份额净值 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回份额 × 赎回日基金份额净值 - 赎回费用

例一：某投资者赎回 1 万份基金份额，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费用 =  $10,000 \times 1.0160 \times 0.5\% = 50.80$  元

赎回金额 =  $10,000 \times 1.0160 - 50.80 = 10,109.20$  元

2、如果投资者在申购时选择交纳后端申购费用，则赎回金额的计算方法如下：

后端申购费用 = 赎回份额 × 申购日基金份额净值 × 后端申购费率

赎回费用 = 赎回份额 × 赎回日基金份额净值 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回份额 × 赎回日基金份额净值 - 后端申购费用 - 赎回费用

例二：某投资者赎回 1 万份基金份额，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当

日基金份额净值是 1.0160 元,投资者对应的后端申购费是 1.8%,申购时的基金净值为 1.0100 元,则其可得到的赎回金额为:

后端申购费用=10,000×1.0100×1.8%=181.80 元

赎回费用=10,000×1.0160×0.5%=50.80 元

赎回金额=10,000×1.0160-181.80-50.80=9,927.40 元

3、赎回金额计算结果保留到小数点后两位,第三位四舍五入。

(四) 基金份额净值的计算公式

基金份额净值=基金资产净值总额/发行在外的基金份额总数

本基金 T 日的基金份额净值在当天收市后计算,并在 T+1 日公告。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。

## 八、暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请:

(一) 因不可抗力导致基金无法正常工作。

(二) 证券交易所在交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

(三) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

(四) 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时。

(五) 基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

(六) 接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总额 50%的。

(七) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。

(八) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形时,基金管理人应当根据有关规定在中国证监会指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝,被拒绝的申购款项将

退还给投资者。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

## 九、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项:

- (一) 因不可抗力导致基金无法正常运作;
- (二) 证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值;
- (三) 连续两个开放日发生巨额赎回;
- (四) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况;
- (五) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。
- (六) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时,基金管理人应在当日报中国证监会备案,已接受的赎回申请,基金管理人应按时足额支付;如暂时不能足额支付,可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付,但不得超过正常支付时间 20 个工作日,并在中国证监会指定媒体上公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### (一) 巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一日的基金总份额的 10%,即认为是发生了巨额赎回。

### (二) 巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定



全额赎回或部分顺延赎回。

1、全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2、部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；投资者未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

3、在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过前一日基金总份额20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过前一日基金总份额20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“1、全额赎回”或“2、部分顺延赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。

4、暂停赎回：连续2日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间20个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

### （三）巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案，并在2日内通过指定媒体、基金管理人的公司网站或销售机构的网点刊登公告，说明有关处理方法。

## 十一、其他暂停申购和赎回的情形及处理方式

发生法律、法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购和/或赎回的情形,基金管理人在报中国证监会核准或备案后应当立即在指定媒体及基金管理人网站刊登暂停申购和/或赎回公告。

## 十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

(一) 发生上述暂停申购或赎回情况的,基金管理人当日应立即向中国证监会备案,并在规定期限内至少在一种指定媒体上刊登暂停公告。

(二) 如发生暂停的时间为1日,第2个工作日基金管理人应在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近1个开放日的基金份额净值。

(三) 如发生暂停的时间超过1日但少于2周,暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前2日在至少一种指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近1个开放日的基金份额净值。

(四) 如发生暂停的时间超过2周,暂停期间,基金管理人应每2周至少刊登暂停公告1次。暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,基金管理人应提前2日在至少一种指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公告最近1个开放日的基金份额净值。

## 十三、基金转换

为方便基金份额持有人,本公司已在部分销售机构开通本基金和旗下各只基金的基金转换业务。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定以基金管理人对外发布的公告为准。

## 十四、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金份额登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。

继承是指基金份额持有人死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;

捐赠指受理基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金份额登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请自申请受理日起2个月内办理，并按基金份额登记机构规定的标准收费。

## 十五、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

## 十六、定期定额投资计划

为方便投资者或基金份额持有人，本基金已在部分销售机构开通定期定额投资业务，具体内容详见基金管理人和其他销售机构有关基金定期定额投资的公告。未来在各项技术条件和准备完备的情况下，将在其它销售渠道酌情增加本基金的定期定额投资业务。

## 十七、基金的冻结和解冻

基金份额登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或是基金份额的冻结与解冻。基金账户或是基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结。

## 第八部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金重点投资受益于国家发展战略并具有成长潜力的上市公司, 分享国民经济快速发展带来的成长性收益, 追求管理资产的长期稳定增值。

### 二、投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产的比例为基金资产的 60%—95% (其中投资于权证的比例为基金净资产的 0%—3%), 投资于债券资产的比例为基金资产的 5%—40%。其中投资于现金 (不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等) 或者到期日在一年以内的政府债券的比例大于等于基金净资产的 5%。

### 三、投资理念

本基金通过分析宏观经济发展战略, 确定基金重点投资的行业, 在风险控制之的框架之下进行积极主动的投资管理, 自上而下配置资产, 自下而上精选证券。

### 四、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为: 标普中国 A 股 300 指数收益率 $\times$ 70%+中证综合债指数收益率 $\times$ 30%。

标普中国 A 股 300 指数采用国际上广泛使用的全球行业分类标准(GICS), 选择中国 A 股市场中市值规模大、流动性强和基本因素良好的 300 家上市公司作为样本股, 并根据自由流通市值加权计算。该指数编制方法清晰透明, 具有独立性, 符合国际标准, 具有较强的公正性与权威性, 能够反映 A 股市场总体发展趋势并具有良好的投资价值。

中证综合债指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，能够体现中国债券市场整体走势，反应本基金对债券配置的业绩。

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。

法律法规另有规定的，从其规定。

## 五、风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

## 六、投资策略

### (一) 资产配置策略

本基金为“自上而下配置资产，自下而上精选证券”的混合型基金。本基金在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率的基础上，制订本基金资产在股票、债券和现金等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。

本基金在做类别资产的主动性配置时所考虑的因素主要有：整体市场估值水平、宏观经济运行状况、利率水平、国家政策以及本基金独有的对系统性风险的个性化判断。

在整体市场估值水平方面，本基金主要关注市场整体估值水平的高低以及市场整体盈利增长速度的高低；在宏观经济方面，本基金主要关注GDP、工业增加值以及社会商品零售总额的增长速度；在利率水平方面，主要关注由于市场收益率水平变化引起的资本成本的变化；在政策方面主要关注政府货币政策、财政政策以及其他产业政策的变动。

本基金还根据基金管理人的经验与国内证券市场的现状，利用自创的市场成长风险值对市场的系统性风险进行判断。市场成长风险值是根据本基金管理人开

发的数量化模型得到的，该指标度量了市场成长性风险，值越高，市场成长风险越大，相反，值越小，市场成长风险越小。本基金根据市场成长风险值来判断风险区域，最后通过市场成长风险值的大小将市场划分为高风险区域、中风险区域和低风险区域。如市场成长风险值低于1，则判断市场为低风险区，如市场成长风险值高于1.5，则判断市场进入高风险区；在高风险区域适度减仓，在低风险区域适度加仓，在中风险区域中调整资产配置结构。

## (二) 股票资产投资策略

### 1、行业配置

本基金将依据宏观经济发展方向、国家重点投资支持领域来分析各个行业受益的程度，通过三重评价，即产业政策支持力度、受益大小、进入壁垒，来判断各个行业的受益大小与持续性，由专家打分的形式确定行业的配置。

本基金将定期或不定期全面审查重点投资的行业，并且根据宏观经济变化以及执行情况适时调整。

未来几年内将主要配置于以下相关行业：现代服务业与消费升级、先进制造业、节能与新能源、环保与循环经济、教育、农业、具有自主创新能力的生物医药、电子等行业内的上市公司。

### 2、股票选择

本基金的择股范围将主要集中在受益于国家经济产业政策和重点投资支持的相关行业内的上市公司，尤其是此类行业中具有代表性、竞争力强的优势企业。

本基金认为受益于国家宏观经济发展战略的行业中最有可能产生成长性公司。本基金通过在受益于国家产业政策支持的行业中寻找成长性上市公司，进而分享国民经济高速增长带来的成长性收益。本基金还利用自创的成长风险值指标来指导投资、规避成长风险。

上市公司股票的成长风险值是根据GARP (Growth at Rational Price) 理念，考虑了股票的价格、每股收益增长、每股现金流量、主营业务收入增长率、主营业务利润增长、净资产收益率、市净率等因素，通过模型优化得到的指标。该指标度量了股票成长性风险，值越高，股票的成长风险越大，相反，值越小股票的成长风险越小。

成长风险值指标计算公式如下所示:

$$GRV = \frac{C_1PE + C_2PB}{(C_3G_1 + C_4G_2 + C_5G_3 + C_6G_4)}$$

其中  $C_1, C_2, C_3, C_4, C_5, C_6$  为常数,  $G_1, G_2, G_3, G_4$  分别为主营业务收入、主营业务利润、每股收益、净资产收益率的平均增长率, PE 为市盈率, PB 为市净率。

为了增强本基金的个股精选及时机把握能力,将对由行业筛选出的股票以成长风险值为依据进行更深层次挑选,重点锁定 150 只个股,并在此基础上构建东方策略成长优选股票库,为管理人制定投资方案提供有效的决策依据。

本基金通过成长风险值控制成长风险,以合理的价格投资于优秀公司和/或相对价值低估的其他公司;通过组合投资有效分散风险,谋求基金资产长期稳定的增长。

在对股票进行评价时,除上述因素外,本基金还考虑以下相关因素:

(1) 行业代表性:上市公司的总资产在整个行业占的比重,企业的业绩的变化能够反应这个行业的业绩变化;

(2) 区域经济实力:如企业所属地域的人均 GDP;

(3) 公司背景及管理:包括公司的历史沿革、公司治理结构、体制与效率、决策层的素质和能力、激励机制、凝聚力、部门合作与协调、团队年龄结构、知识结构等;

(4) 行业中的竞争地位:包括行业特性,行业近年来发展动态,行业的发展前景(替代产品的发展、国家特殊的行业政策、国际市场的变化情况),公司在行业中的地位 and 竞争优势(如市场占有率变化等),公司有关经济效益指标与行业平均水平或相关公司的比较;

(5) 业务分析:包括主要影响因素分析(原材料供应及市场情况、销售情况、产品技术含量和科研开发、主要竞争对手、产品价格);成本及利润分析(主要产品或项目的成本、生产能力、实际产销量、利润及毛利率、增长速度等等);投资项目分析(在建及计划投资项目的产品市场、收益预测及主要影响因素、未来 3 年内新项目的利润贡献预测等)。

### 3、股票组合构建

在构建股票组合时,基金经理将考虑以下因素:

### (1) 个股的相关性矩阵

基金经理通过个股间的相关性矩阵分析, 尽量使组合内个股之间的相关性最小, 达到分散投资从而分散风险的目标;

### (2) 行业的集中度

基金经理将根据对相关行业的把握, 适当分散投资, 避免选择的股票行业集中度过高。

### (三) 债券资产投资策略和其他资产投资策略

#### 1、债券投资策略

本基金债券投资管理的目标是分散股票投资的市场风险, 保持投资组合稳定收益和充分流动性。

在选择国债品种中, 本基金将重点分析国债品种所蕴含的利率风险和流动性风险, 根据利率预测模型构造最佳期限结构的国债组合; 在选择金融债、企业债品种时, 本基金将重点分析债券的市场风险以及发行人的资信品质。资信品质主要考察发行机构及担保机构的财务结构安全性、历史违约/担保纪录等。本基金还将关注可转债价格与其所对应股票价格的相对变化, 综合考虑可转债的市场流动性等因素, 决定投资可转债的品种和比例, 捕捉其套利机会。

#### 2、权证投资策略

本基金的权证投资策略主要包括以下几个方面:

(1) 本基金主要采用市场公认的多种期权定价模型对权证进行定价, 作为权证投资的价值基准;

(2) 本基金将深入研究行权价格、标的价格和权证价格之间的内在关系, 以利用非完全有效市场中的无风险套利机会; 根据权证对应公司基本面的研究估值, 结合权证理论价值进行权证的趋势投资;

(3) 利用权证衍生工具的特性, 本基金通过权证与证券的组合投资, 来达到改善组合风险收益特征的目的; 包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略、保护组合成本策略、获利保护策略等。

#### 3、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、收益率曲线变动分析、收益



率利差分析和公司基本面分析、把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

## 七、投资管理流程

研究、决策、组合构建、交易、风险监控、评估和组合调整的有机配合共同构成了本基金的投资管理流程。严格的投资管理流程可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

### (一) 研究

本基金的投资研究主要依托于公司整体的研究平台，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、货币政策和财政政策执行情况进行分析，深入研究行业景气状况、市场合理估值水平，预测利率变化趋势；深入研究其合理的投资价值；据此提出大类资产配置、行业配置、个股配置的投资建议。

### (二) 资产配置决策

投资决策委员会依据上述研究报告，对基金的投资方向、资产配置比例等提出指导性意见。

基金经理基于研究员的投资建议，根据自己对未来一段时期内证券市场走势的基本判断，对基金资产的投资，制定月度资产配置和行业配置计划，并报投资决策委员会审批，审批通过，方可按计划执行。

### (三) 组合构建

大类资产配置比例范围确定后，基金经理参考研究员的个股投资建议，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。

### (四) 交易执行

中央交易室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。

### (五) 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。

#### (六) 风险绩效评估

风险管理部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。基金经理可以据以检讨投资策略, 进而调整投资组合。

#### (七) 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, 对投资组合进行动态调整, 使之不断得到优化。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下, 有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理流程进行调整。

## 八、投资限制

基金管理人依据有关法律法规及基金合同和其他有关规定, 运作管理本基金。本基金投资组合遵循下列规定:

#### (一) 组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点, 通过分散投资降低基金财产的非系统性风险, 保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:

- 1、本基金持有一家上市公司的股票, 其市值不超过基金资产净值的 10%;
- 2、本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的 3%;
- 3、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%;
- 4、本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的 10%;
- 5、本基金持有的同一资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%;
- 6、本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%;

7、本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

8、本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%，中国证监会规定的特殊品种除外；

9、进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；

10、本基金投资于股票资产的比例为基金资产的60%—95%（其中投资于权证的比例为基金净资产的0%—3%），投资于债券资产的比例为基金资产的5%—40%。其中投资于现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券的比例大于等于基金净资产的5%；

11、本基金投资于资产支持证券，应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券；

12、本基金财产参与股票发行申购，基金所申报的金额不超过基金的总资产，基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

13、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

14、本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；

15、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

16、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

17、法律法规及中国证监会规定的其他限制。

除第10项中“投资于现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）

或者到期日在一年以内的政府债券的比例大于等于基金净资产的5%”及第11、15、16项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述项规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## (二) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或者提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 5、向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6、买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- 7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、依照法律法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

## 九、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

## 十、基金投资组合报告

本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。

基金托管人根据本基金合同规定，已复核了本报告中的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 2018 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	347,414,776.15	75.55
	其中: 股票	347,414,776.15	75.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,879,000.00	6.50
	其中: 债券	29,879,000.00	6.50
	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	40,000,140.00	8.70
	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	41,345,288.04	8.99
8	其他资产	1,228,102.37	0.27
9	合计	459,867,306.56	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 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,687,000.00	1.31
B	采矿业	35,076,000.00	8.05
C	制造业	231,156,105.08	53.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,402.87	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	36,659.62	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,675,908.58	10.72
J	金融业	10,953,700.00	2.52
K	房地产业	6,513,000.00	1.50
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	4,118,000.00	0.95
R	文化、体育和娱乐业	7,172,000.00	1.65
S	综合	-	-
	合计	347,414,776.15	79.77

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	000661	长春高新	120,000	22,029,600.00	5.06
2	600547	山东黄金	650,000	18,876,000.00	4.33
3	600028	中国石化	2,500,000	16,200,000.00	3.72
4	600276	恒瑞医药	160,000	13,921,600.00	3.20
5	002056	横店东磁	1,315,000	12,702,900.00	2.92
6	002153	石基信息	460,000	12,341,800.00	2.83
7	002439	启明星辰	440,000	12,038,400.00	2.76
8	600760	中航沈飞	340,000	11,723,200.00	2.69
9	002460	赣锋锂业	150,000	11,607,000.00	2.67
10	600038	中直股份	240,000	11,604,000.00	2.66

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(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,879,000.00	6.86
	其中:政策性金融债	29,879,000.00	6.86
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	29,879,000.00	6.86

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	170408	17农发08	200,000	20,000,000.00	4.59
2	160208	16国开08	100,000	9,879,000.00	2.27
3					
4					
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。

## 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。

## 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股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 10、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。

## 11、投资组合报告附注

(1) 本基金所持有的长春高新(000661)于2017年6月15日公告,公司涉及一项房屋所有权纠纷,该案已由长春市中级人民法院受理。案件内容为:“永长小区”项目是本公司的子公司—长春高新房地产开发有限责任公司(原长春市高新建设开发公司)(以下简称“高新开发”)与长春市滨河物业开发有限公司(以下简称“滨河物业”)于1999年开始联合开发建设的房地产项目,当时合作确定由滨河物业出项目审批手续及少量现金,高新开发出资金。后由于滨河物业后续资金投入不足等自身原因,2006年10月9日,双方经平等协商,签订了《永长小区项目清算及处理意见协议书》,明确约定永长小区剩余房屋由高新开发销售,销售收入归高新开发所有,滨河物业退出永长项目,该协议书经长春市中级人民法院终审判决、吉林省高级人民法院再审裁定确认为合法有效。截至2008年末,公司应收永长项目往来款2,648.00万元。《物权法》实施后,滨河物业债权人(非永长项目所涉)——长春东煤多种经营供销公司影城路经销部(以下简称“东煤公司”)以项目登记在滨河物业名下为由,从2007年4月开始,连续启动对永长小区房屋的查封、诉讼程序,目前已被长春市三家基层法院查封房屋20套,建筑面积8,153 m<sup>2</sup>,公司已成立专门机构积极应对,我们正基于“永长小区系高新

开发出资建设而原始取得房屋所有权、析产协议合法有效”和省、市、区三级法院的有效判决等事实 and 法律依据，出庭应诉抗辩，依法维护自身合法权益。2017年6月15日，长春市中级人民法院经审理作出(2017)吉01民初88号民事一审判决书，驳回东煤公司的诉讼请求。东煤公司已于2017年7月6日向吉林省高级人民法院提出上诉。

公司公告以上纠纷不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的中航沈飞(600760)于2017年7月29日公告，公司涉及一项贷款纠纷，该案已由山东省威海市中级人民法院受理。案件内容为：“根据《民事起诉状》，中国工商银行文登支行分别于1998年3月31日、12月4日、12月21日及2000年7月31日与文登黑豹签订《借款合同》，并分别向文登黑豹发放借款3,670万元(1998年3月31日)、28万元(1998年12月4日)、54万元(1998年12月21日)、507.5万元(2000年7月31日)，以上债权金额总计4,259.5万元。2005年5月27日，中国工商银行文登支行将上述债权转让给中国华融资产管理公司济南办事处，并于2005年6月6日在《大众日报》公告通知借款人。2007年8月13日，中国华融资产管理公司济南办事处将上述债权转让给上海南龙投资有限公司，并于2007年8月24日在《经济导报》公告通知借款人。2016年12月6日，上海南龙投资有限公司将上述债权转让给原告，并于2016年12月15日在《山东法制报》公告通知借款人。原告认为其依法对文登黑豹享有债权，文登黑豹未按期支付债务的行为构成违约，向山东省威海市中级人民法院提起民事诉讼。

(二) 诉讼请求及理由 1、诉讼请求 (1) 请求判令文登黑豹向原告偿还债务本金4,259.5万元并支付利息1,664万元。(2) 请求判令本公司及其余被告对文登黑豹上述债务及利息不能清偿的部分承担补充赔偿责任。(3) 本案受理费、保全费等涉诉费用由本案被告共同承担。2、理由根据《民事起诉状》，与原告主张的诉讼请求相关的理由如下：(1) 文登黑豹于1996年10月25日成立，原名山东文登文龙汽车(集团)有限公司，股东为山东文登汽车改装厂和山东文登此车改装厂工会。公司于2013年6月13日以60万元购买了文登黑豹的全部股权，成为文登黑豹唯一股东。(2) 2015年8月28日以前，文登黑豹为公司的全资子公司，注册资本为2,000万元。2015年8月28日，本案第二、三被告对文登黑豹增资入股



成为文登黑豹的股东；增资后，文登黑豹的注册资本由2,000万元增至10,000万元，其中，第二被告认缴新增注册资本5,000万元，第三被告认缴新增注册资本3,000万元，至今第二第三被告认缴的增资款未实缴到位。(3) 第二被告为有限合伙企业，第五被告为第二被告的普通合伙人；第六、七、八被告为文登黑豹的董事、高级管理人员。根据《合同法》、《公司法》、《合伙企业法》、《证券法》、最高人民法院《关于适用若干问题的规定(三)》等相关法律之规定，文登黑豹应履行偿还借款本息的义务；第二、三被告因未履行出资义务，应当对文登黑豹所不能清偿的上述债务承担补充赔偿责任；公司作为文登黑豹的发起人应对第二、三被告所应承担的上述赔偿责任承担连带责任；第五被告作为第二被告(有限合伙企业)的普通合伙人，应当对第二被告所应承担的上述赔偿责任承担连带责任；第六、七、八被告作为文登黑豹的董事、高级管理人员，对文登黑豹未尽到其依法应附有的忠实义务和勤勉义务，亦应对文登黑豹所不能清偿的上述债务承担补充赔偿责任。上述诉讼请求与理由均为原告的主张，原告主张的事实与理由尚未经有权机关判决。2017年7月29日，山东神娃企业管理咨询有限公司(以下简称“原告”)向山东省威海市中级人民法院递交民事起诉状，以企业借贷纠纷为由将本公司参股公司山东文登黑豹汽车有限公司(以下简称“文登黑豹”)列为第一被告、本公司列为第四被告、北京万盈世纪投资管理中心(有限合伙)列为第二被告、诚融投资管理(北京)有限公司列为第三被告、龙江(北京)投资基金有限公司列为第五被告、本公司经理王志刚列为第六被告、文登黑豹监事王立文列为第七被告、文登黑豹总经理荣浩列为第八被告进行起诉。2017年7月14日，原告向山东省威海市中级人民法院提交《增加诉讼请求申请书》，在原诉讼请求基础上主张偿还涉案债权的利息部分。公司于近日收到山东省威海市中级人民法院送达的《增加诉讼请求申请书》。

同时，公司由于违反了未及时披露重大事项而被中国证监会予以处分。具体内容：经查，2016年12月30日中航黑豹股份有限公司(以下简称“你公司”)控股子公司安徽开乐专用车辆股份有限公司与中航工业凯通(阜阳)车辆科技有限公司达成的金额1,735.31万元的两项专有技术独占使用许可交易属关联交易，但你公司未按规定履行审议程序，亦未及时履行信息披露义务。同时，结合公司

2017年4月1日发布的《关于会计差错更正的公告》，显示3月3日发布的《2016年年度报告》存在财务信息差错。公司上述行为，违反了《上市公司信息披露管理办法》（证监会令第40号）第二条相关规定，相关责任人违反了第三条相关规定。根据《上市公司信息披露管理办法》（证监会令第40号）第五十九条的规定，我局决定对你公司采取出具警示函的监管措施；根据该办法第五十八条、第五十九条的规定，我局决定对在上述事项中负有重要责任的董事长李晓义、总经理王志刚、财务负责人朱清海、董事会秘书严楠采取出具警示函的监管措施。你公司及相关负责人应引以为戒，按照有关法律法规的规定，切实做好公司内部控制及信息披露工作。

公司公告以上内容不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

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。

本基金投资长春高新主要基于以下原因：公司旗下的金赛药业是国内规模最大的基因工程制药企业和亚洲最大的重组人生长激素生产企业，在生长激素领域具备渠道优势、产品优势，业绩稳健增长，具备长期投资价值。

本基金投资中航沈飞主要基于以下原因：公司为我国歼击机主要生产厂商之一，防务航空产品主要包括歼-11系列、歼-15、歼-16及FC31。未来随着空中打击新体系的确立，歼-16或将与四代隐身战机组成多批次空中打击梯队，该机型需求量将出现大幅上升。公司将受益于各型歼击机的持续列装，航空装备业绩或将

保持快速稳定增长。我们认为，公司具备一定的投资价值。

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。

(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) 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	409,192.53
2	应收证券清算款	28,167.70
3	应收股利	-
4	应收利息	726,448.36
5	应收申购款	64,293.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,228,102.37

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 第九部分 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。

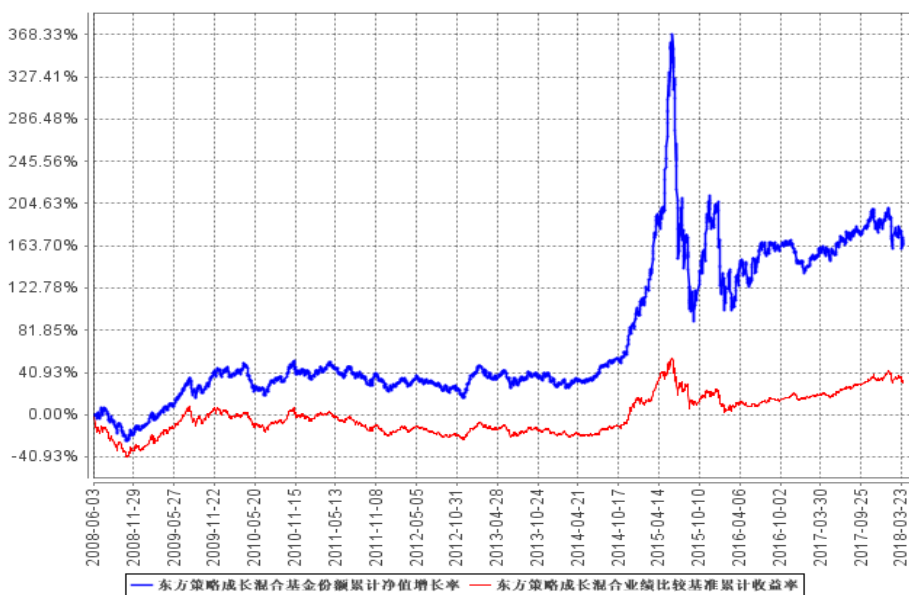
### 一、基金净值表现

历史各时间段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
2008.06.03-2008.12.31	-14.61%	2.05%	-35.06%	2.12%	20.45%	-0.07%
2009.01.01-2009.12.31	67.65%	1.21%	61.47%	1.43%	6.18%	-0.22%
2010.01.01-2010.12.31	-1.66%	1.14%	-6.77%	1.10%	5.11%	0.04%
2011.01.01-2011.12.31	-10.95%	1.02%	-17.47%	0.91%	6.52%	0.11%
2012.01.01-2012.12.31	10.07%	0.93%	6.71%	0.88%	3.36%	0.05%
2013.01.01-2013.12.31	-1.96%	1.03%	-2.90%	0.96%	0.94%	0.07%
2014.01.01-2014.12.31	46.39%	0.88%	36.26%	0.84%	10.13%	0.04%
2015.01.01-2015.12.31	50.23%	2.97%	7.62%	1.70%	42.61%	1.27%
2016.01.01-2016.12.31	-17.07%	2.10%	-6.20%	0.94%	-10.87%	1.16%
2017.01.01-2017.12.31	15.26%	0.88%	17.17%	0.45%	-1.91%	0.43%
2018.01.01-2018.03.31	-4.47%	1.40%	-1.66%	0.82%	-2.81%	0.58%

### 二、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

东方策略成长混合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



## 第十部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和份额登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和其他销售机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十一部分 基金资产的估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### 二、估值方法

#### (一) 股票估值方法：

1、上市流通股票按估值日其所在证券交易场所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

#### 2、未上市股票的估值：

(1) 首次发行未上市的股票，按成本计量；

(2) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；

(4) 非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

3、在任何情况下，基金管理人如采用本项第 1—2 小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第 1—2 小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

4、国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### (二) 债券估值方法：

1、证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；

2、证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中

所含的应收利息得到的净价进行估值, 估值日没有交易的, 以最近交易日的收盘净价估值;

3、发行未上市债券采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本进行后续计量;

4、在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种, 采用估值技术确定公允价值;

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的, 按债券所处的市场分别估值;

6、在任何情况下, 基金管理人如采用本项第 1-5 小项规定的方法对基金资产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如果基金管理人认为按本项第 1-5 小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值, 基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值;

7、国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

### (三) 权证估值方法:

1、基金持有的权证, 从持有确认日起到卖出日或行权日止, 上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值; 估值日没有交易的, 按最近交易日的收盘价估值;

未上市交易的权证采用估值技术确定公允价值; 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本计量;

2、在任何情况下, 基金管理人如采用本项第 1 小项规定的方法对基金资产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如果基金管理人认为按本项第 1 小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人可根据具体情况, 并与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值;

3、国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

(四) 如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时, 应立即通知对方, 共同查明原因, 双方协商解决。



(五) 根据有关法律法规, 基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任, 因此, 就与本基金有关的会计问题, 如经相关各方在平等基础上充分讨论后, 仍无法达成一致的意见, 按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### 三、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### 四、估值程序

(一) 基金份额净值是按照每个开放日闭市后, 基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算, 精确到 0.0001 元, 小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的, 从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值, 并按规定公告。

(二) 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个开放日对基金资产估值后, 将基金份额净值结果发送基金托管人, 经基金托管人复核无误后, 由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### 五、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生差错时, 视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应以下约定处理:

#### (一) 差错类型

本基金运作过程中, 如果由于基金管理人或基金托管人、或登记结算机构、或其他销售机构、或投资者自身的过错造成差错, 导致其他当事人遭受损失的, 过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人(“受损方”)按下述“差错处理原则”给予赔偿, 承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## (二) 差错处理原则

1、差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

2、差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

3、因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

4、差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

5、差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向

差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

6、如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

7、按法律法规规定的其他原则处理差错。

### (三) 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

1、查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

2、根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

3、根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

4、根据差错处理的方法，需要修改基金登记结算机构交易数据的，由基金登记结算机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### (四) 基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

1、基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

2、错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告。

3、因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

4、基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

5、前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 六、暂停估值的情形

(一) 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业

时;

(二) 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

(三) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定时, 基金管理人经与基金托管人协商一致的;

(四) 如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况, 会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的;

(五) 中国证监会认定的其它情形。

## 七、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算, 基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人, 由基金管理人对基金净值予以公布。

## 八、特殊情况的处理

(一) 基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第 3 项、债券估值方法的第 6 项或权证估值方法的第 2 项进行估值时, 所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

(二) 由于不可抗力原因, 或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误, 或国家会计政策变更、市场规则变更等, 基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查, 但未能发现错误的, 由此造成的基金资产估值错误, 基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 第十二部分 基金的收益与分配

### 一、基金收益的构成

- (一) 买卖证券差价;
- (二) 基金投资所得红利、股息、债券利息;
- (三) 银行存款利息;
- (四) 已实现的其他合法收入;
- (五) 证券持有期间产生的公允价值变动。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### 二、基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### 三、收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则:

- (一) 本基金的每份基金份额享有同等分配权;
- (二) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值;
- (三) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金份额登记机构可将投资者的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额。
- (四) 本基金收益每年最多分配12次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%;
- (五) 本基金收益分配方式为现金分红。投资者可选择将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;本基金默认的收益分配方式是现金分红;
- (六) 基金投资当期出现累计净亏损,则不进行收益分配;
- (七) 基金当期收益应先弥补以往年度亏损后,方可进行当期收益分配;

(八) 法律法规或监管机构另有规定的, 从其规定。

#### 四、收益分配方案

本基金收益分配方案中应载明基金收益的范围、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式及有关手续费等内容。

#### 五、收益分配的时间和程序

(一) 基金收益分配方案由基金管理人拟订, 由基金托管人复核, 依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告并报中国证监会备案;

(二) 在分配方案公布后(依据具体方案的规定), 基金管理人就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令, 基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

## 第十三部分 基金的费用与税收

### 一、基金费用的种类

- (一) 基金管理人的管理费;
- (二) 基金托管人的托管费;
- (三) 基金财产拨划支付的银行费用;
- (四) 基金合同生效后的基金信息披露费用;
- (五) 基金份额持有人大会费用;
- (六) 基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费;
- (七) 基金的证券交易费用;

(八) 在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明。

- (九) 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

二、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

### 三、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

- (一) 基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}, \text{本基金年管理费率为 } 1.5\%$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

- (二) 基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法

如下:

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ , 本基金年托管费率为 0.25%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提, 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令, 经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人, 若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延。

(三) 上述一中(三)到(九)项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定, 按费用支出金额支付, 列入或摊入当期基金费用。

#### 四、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失, 以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

**五、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率, 无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。**

#### 六、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定, 履行纳税义务。



## 第十四部分 基金的会计与审计

### 一、基金的会计政策

- (一) 基金管理人为本基金的会计责任方;
- (二) 本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日,如果基金首次募集的会计年度,基金合同生效少于2个月,可以并入下一个会计年度;
- (三) 本基金的会计核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位;
- (四) 会计制度执行国家有关的会计制度;
- (五) 本基金独立建账、独立核算;
- (六) 基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算,按照有关规定编制基金会计报表;
- (七) 基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### 二、基金的审计

- (一) 基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- (二) 会计师事务所更换经办注册会计师时,应事先征得基金管理人同意。
- (三) 基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所,经基金托管人(或基金管理人)同意,并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所,基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

## 第十五部分 基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- （一）虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- （二）对证券投资业绩进行预测；
- （三）违规承诺收益或者承担损失；
- （四）诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
- （五）登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- （六）中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

- （一）招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发

售的 3 日前, 将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后, 基金管理人应当在每 6 个月结束之日起 45 日内, 更新招募说明书并登载在网站上, 将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书, 并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后 1 日。

## (二) 基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的 3 日前, 将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上; 基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

## (三) 基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定, 就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告, 并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

## (四) 基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

## (五) 基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的, 基金管理人应当在基金份额上市交易 3 个工作日前, 将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

## (六) 基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1、本基金的基金合同生效后, 在开始办理基金份额申购或者赎回前, 基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值;

2、基金管理人将在每个开放日的次日, 通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介, 披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值;

3、基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日, 将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

## (七) 基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基

基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率,并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### (八) 基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1、基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登载于网站上,将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后,方可披露;

2、基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定报刊上;

3、基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

4、基金合同生效不足 2 个月的,本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告;

5、基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日,分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本和书面报告两种方式。

6、本基金持续运作过程中,应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

7、如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形,为保障其他投资者的权益,基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险,中国证监会认定的特殊情形除外。

#### (九) 临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时,有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书,予以公告,并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案:

1、基金份额持有人大会的召开;

- 2、终止基金合同;
- 3、转换基金运作方式;
- 4、更换基金管理人、基金托管人;
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更;
- 7、基金募集期延长;
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%;
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%;
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚;
- 14、重大关联交易事项;
- 15、基金收益分配事项;
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0、5%;
- 18、基金改聘会计师事务所;
- 19、变更基金份额发售机构;
- 20、基金更换份额登记机构;
- 21、本基金开始办理申购、赎回;
- 22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;
- 23、本基金发生巨额赎回并延期支付;
- 24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;
- 25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;
- 26、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时;

27、中国证监会规定的其他事项。

(十) 澄清公告

在本基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

(十一) 基金份额持有人大会决议

(十二) 中国证监会规定的其他信息

(十三) 信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和基金份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地、有关销售机构及其网点，供公众查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资者也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 第十六部分 风险揭示

投资于本基金的主要风险有以下几方面:

### 一、市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动,将对本基金资产产生潜在风险,主要因素包括:政策因素,如货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响,导致市场价格波动,影响基金收益。经济周期因素,经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响。利率因素,金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动,同时直接影响企业的融资成本和利润水平。上市公司的经营业绩,上市公司的经营业绩会对其证券价格产生影响。

### 二、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约,或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失。

### 三、流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金,或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中,可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难,导致流动性风险,甚至影响基金份额净值。

### 四、产品风险

本基金的设计与管理主要基于本基金的投资理念,可能因基金管理人对其经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全,导致基金的收益水平低于收益基准。

### 五、管理风险

#### (一) 管理风险

本基金可能因为基金管理人的管理水平、手段和技术等因素,而影响基金收

益水平。这种风险可能表现在基金整体的投资组合管理上,例如资产配置、类属配置不能达到预期收益目标;也可能表现在个券个股的选择不能符合本基金的投资风格和投资目标等。

## (二) 新产品创新带来的风险

随着中国证券市场不断发展,各种国外的投资工具也将被逐步引入,这些新的投资工具在为基金资产提供保值增值功能的同时,也会产生一些新的风险,例如利率期货带来的期货投资风险,期权产品带来的定价风险等。

## 六、操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中,因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险,例如,越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中,可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、份额登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

## 七、法律风险

指基金管理或运作过程中,违反国家法律、法规的规定,或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

## 八、其它风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致基金或者基金持有人利益受损。

根据交易所就资金前端额度控制的相关要求,基金管理人(交易参与者)按照前一交易日日终的相关产品的合计资产总额作为每个交易日申报的最高额度,并与基金托管人(结算参与者)明确约定额度申报事项。由于交易所就资金前端



额度控制的规定,从而可能存在影响本基金财产收益的风险。

## 九、声明

本基金由基金管理人依照《基金法》、本基金合同和其他有关法律法规规定募集,并经中国证监会核准。中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,基金份额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之前,请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同,全面认识本基金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,并对认购(或申购)本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险,包括市场风险、管理风险、流动性风险和本基金所投资的股票、债券、衍生品等各种投资工具的相关风险等。在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行承担。

基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好,选择适合自己的基金产品,并且中长期持有。

本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。基金投资者自愿投资于本基金,须自行承担投资风险。

除基金管理人直接办理本基金的销售外,本基金还通过基金其他销售机构销售,但是,基金资产并不是其他销售机构的存款或负债,也没有经基金其他销售机构担保收益,其他销售机构并不能保证其收益或本金安全。

## 第十七部分 基金合同的终止与基金财产的清算

### 一、本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

- (一) 基金份额持有人大会决定终止的；
- (二) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- (三) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- (四) 基金合并、撤销；
- (五) 中国证监会允许的其他情况。

### 二、基金财产清算组

(一) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(二) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(三) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

### 三、基金财产清算程序

基金合同终止后，发布基金清算公告；

- (一) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (二) 对基金财产进行清理和确认；
- (三) 对基金财产进行估价和变现；
- (四) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (五) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (六) 将基金财产清算结果报告中国证监会；

- (七) 参加与基金财产有关的民事诉讼;
- (八) 公布基金财产清算结果;
- (九) 对基金剩余财产进行分配。

#### **四、清算费用**

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

#### **五、基金财产按下列顺序清偿**

- (一) 支付清算费用;
- (二) 交纳所欠税款;
- (三) 清偿基金债务;
- (四) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(一)至(三)项规定清偿前,不分配给基金份额持有人。

#### **六、基金财产清算的公告**

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果经会计师事务所审计,律师事务所出具法律意见书后,由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### **七、基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 第十八部分 基金合同内容摘要

### 一、基金合同当事人及权利义务

#### (一) 基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利包括但不限于：

- 1、依法募集基金；
- 2、自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
- 3、依照基金合同获得基金认购和申购费用、基金赎回手续费用和管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- 4、发售基金份额；
- 5、依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- 6、在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- 7、根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- 8、在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- 9、在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- 10、自行担任或选择、更换份额登记机构，并对份额登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- 11、选择、更换销售机构，并依据销售协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；
- 12、选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- 13、在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- 14、依法召集基金份额持有人大会；

15、法律法规和基金合同规定的其他权利。

## (二) 基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务包括但不限于：

1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7、依法接受基金托管人的监督；

8、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

10、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

12、编制中期和年度基金报告；

13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

14、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

15、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分

配收益;

16、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

17、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

18、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

19、组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

21、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

22、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;

23、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

24、执行生效的基金份额持有人大会的决定;

25、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

26、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利,不谋求对上市公司的控股和直接管理;

27、法律法规、国务院证券监督管理机构和基金合同规定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金托管人的权利包括但不限于:

1、依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

2、监督基金管理人对本基金的投资运作;

3、自本基金合同生效之日起,依法保管基金资产;

4、在基金管理人更换时,提名新任基金管理人;

5、根据本基金合同及有关规定监督基金管理人,对于基金管理人违反本基金

合同或有关法律法规规定的行为,对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;

- 6、依法召集基金份额持有人大会;
- 7、按规定取得基金份额持有人名册资料;
- 8、法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### (四) 基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金托管人的义务包括但不限于:

- 1、安全保管基金财产;
- 2、设立专门的基金托管部,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;
- 3、对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整与独立;
- 4、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;
- 5、保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
- 6、按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;
- 7、保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;
- 8、对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行;如果基金管理人未执行基金合同规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;
- 9、保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
- 10、按照基金合同的约定,根据基金管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;
- 11、办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
- 12、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格;
- 13、按照规定监督基金管理人的投资运作;
- 14、按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
- 15、依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回

回款项;

16、按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;

17、因违反基金合同导致基金财产损失,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

18、基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金向基金管理人追偿;

19、参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

20、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行业监督管理机构,并通知基金管理人;

21、执行生效的基金份额持有人大会的决定;

22、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

23、建立并保存基金份额持有人名册;

24、法律法规、国务院证券监督管理机构和基金合同规定的其他义务。

#### (五) 基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金份额持有人的权利包括但不限于:

1、分享基金财产收益;

2、参与分配清算后的剩余基金财产;

3、依法申请赎回其持有的基金份额;

4、按照规定要求召开基金份额持有人大会;

5、出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

6、查阅或者复制公开披露的基金信息资料;

7、监督基金管理人的投资运作;

8、对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;

9、法律法规和基金合同规定的其他权利。



每份基金份额具有同等的合法权益。

#### (六) 基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- 1、遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- 2、交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- 3、在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- 4、不从事任何有损基金及基金份额持有人合法权益的活动；
- 5、执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 6、返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- 7、法律法规和基金合同规定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会

(一) 基金份额持有人大会由基金份额持有人共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

#### (二) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额10%以上（含10%，下同）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略；
- (5) 变更基金份额持有人大会程序；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- (8) 本基金与其他基金的合并；
- (9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2、出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费、其他应由基金承担的费用；
- (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- (3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；
- (4) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- (6) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### (三) 召集人和召集方式

1、除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集，开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

3、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持

有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前30日向中国证监会备案。

5、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

#### (四) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前30天在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和出席方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 会议形式；
- (4) 议事程序；
- (5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- (6) 代理投票的授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- (7) 表决方式；
- (8) 会务常设联系人姓名、电话；
- (9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (10) 召集人需要通知的其他事项。

2、采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。

## (五) 基金份额持有人出席会议的方式

### 1、会议方式

(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

(2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

(3) 通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

(4) 会议的召开方式由召集人确定，但决定转换基金运作方式、基金管理人更换或基金托管人的更换、终止基金合同的事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

### 2、召开基金份额持有人大会的条件

#### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应占权益登记日基金总份额的50%以上（含50%，下同）；

2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托书代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

#### (2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

2) 召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，基金管理人或基金托管人经通知拒不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上;

4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表, 同时提交的持有基金份额的凭证符合法律法规、基金合同和会议通知的规定, 并与登记注册机构记录相符;

5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时, 除非在计票时有充分的相反证据证明, 否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决, 表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决, 但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

#### (六) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

(1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案, 大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系, 并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的, 应提交大会审议; 对于不符合上述要求的, 不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决, 应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决, 需征得原提案人同意; 原提案人不同意变更的, 大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定, 并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后, 如果需要对原有提案进行修改, 应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则, 会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下, 首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项, 确定和公布监票人, 然后由大会主持人宣读提案, 经讨论后进行表决, 经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的, 其授权代表未能主持大会的情况下, 由基金托管人授权代表主持; 如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会, 则由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

### (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下, 首先由召集人提前 30 天公布提案, 在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

## 3、基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### (七) 决议形成的条件、表决方式、程序

1、基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

#### (1) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%以上通过方为有效, 除下列②所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过;

#### (2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方为有效;涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

3、基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会核准,或者备案,并予以公告。

4、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

5、基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

#### (八) 计票

##### 1、现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集,则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举3名基金份额持有人担任监票人。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点,由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑,可以对投票数进行重新清点;如会议主持人未进行重新清点,而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议,其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

##### 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

如基金管理人拒绝按照上述规定对基金份额持有人表决后的计票程序进行监督或配合,则基金托管人应当指派授权代表完成计票程序;如基金托管人拒绝按

照上述规定对基金份额持有人表决后的计票程序进行监督或配合,则基金管理人应当指派授权代表完成计票程序;如基金管理人、基金托管人经通知仍拒绝派代表监督计票的,不影响大会会议决议的效力。

(九)基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效执行。

2、生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

3、基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

### 三、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

(一)基金合同的变更:

1、基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的,应召开基金份额持有人大会,基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1) 终止基金合同;

(2) 转换基金运作方式;

(3) 变更基金类别;

(4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略;

(5) 变更基金份额持有人大会程序;

(6) 更换基金管理人、基金托管人;

(7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;

(8) 本基金与其他基金的合并;

(9) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。



但出现下列情况时,可不经基金份额持有人大会决议,由基金管理人和基金托管人同意变更后公布,并报中国证监会备案:

- (1) 因相应的法律法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行变更的情形;
- (2) 基金合同的变更并不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化的;
- (3) 因为当事人名称、住所、法定代表人变更,当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的。

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准或备案,并于中国证监会出具无异议意见后生效执行,并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。

#### (二) 本基金合同的终止:

有下列情形之一的,本基金合同经中国证监会核准后将终止:

- 1、基金份额持有人大会决定终止的;
- 2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金管理人的职务,而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务;
- 3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金托管人的职务,而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务;
- 4、基金合并、撤销;
- 5、中国证监会允许的其他情况。

#### (三) 基金财产的清算

##### 1、基金财产清算组

(1) 基金合同终止时,成立基金财产清算组,基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

## 2、基金财产清算程序

基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

- (1) 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2) 对基金财产进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估价和变现；
- (4) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (7) 参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (8) 公布基金财产清算结果；
- (9) 对基金剩余财产进行分配。

## 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

## 4、基金财产按下列顺序清偿

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

## 5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

## 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

#### 四、争议的处理

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

#### 五、基金合同的效力

本基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、其他销售机构和份额登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

## 第十九部分 基金托管协议内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

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

成立日期：2004 年 6 月 11 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]80 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：叁亿元人民币

营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日

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和中国证监会许可的其他业务。

#### (二) 基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；

办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产的比例为基金资产的 60%—95%（其中投资于权证的比例为基金净资产的 0%—3%），投资于债券资产的比例为基金资产的 5%—40%（其中投资于现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券的比例大于等于基金净资产的 5%）。

(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

- 1、本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- 2、本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- 3、本基金持有的同一资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- 4、本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- 5、本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外；
- 6、进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值

的 40%;

7、本基金投资于股票资产的比例为基金资产的 60%—95% (其中投资于权证的比例为基金净资产的 0%—3%), 投资于债券资产的比例为基金资产的 5%—40% (其中投资于现金 (不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等) 或者到期日在一年以内的政府债券的比例大于等于基金净资产的 5%);

8、本基金投资于资产支持证券, 应投资于信用级别评级为 BBB 以上 (含 BBB) 的资产支持证券;

9、本基金财产参与股票发行申购, 基金所申报的金额不超过基金的总资产, 基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

10、本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

11、本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%;

12、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%; 因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的, 本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

13、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

14、法律法规及中国证监会规定的其他限制。

除第 7 项中“投资于现金 (不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等) 或者到期日在一年以内的政府债券的比例大于等于基金净资产的 5%”及第 8、12、13 项外, 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定的投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

(三)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定,基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方交易证券名单。基金管理人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性,并负责及时将更新后的名单发送基金托管人。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生,如基金托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时,基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易,基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生,只能进行事后结算,基金托管人不承担由此造成的损失,并向中国证监会报告。

(四)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单,并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间交易市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新,新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易,仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的,应向基金托管人说明理由,并在与交易对手发生交易前 3 个工作日内与基金

托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,并承担交易对手不履行合同造成的损失,基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失,基金管理人负责向相关交易对手追偿,基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时,基金托管人应及时提醒基金管理人,并不承担由此造成的任何损失和责任。

(五)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(六)基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作中违反法律法规和基金合同的规定,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,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。基金管理人未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

(七)基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(八)若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,由此造成的损失由基金管理人承担。

(九)基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为,应及时报告中国证监会,



同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

(一) 基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(二) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

(三) 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

### 四、基金财产的保管

(一) 基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。

- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- 5、基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。
- 6、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担任何责任。
- 7、除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## (二) 基金募集期间及募集资金的验资

- 1、基金募集期间的资金应存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。
- 2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。
- 4、若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

## (三) 基金资金账户的开立和管理

- 1、基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的资金账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。
- 2、基金资金账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金资金账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4、在符合法律法规规定的条件下,基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

#### (四) 基金证券账户的开立和管理

1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2、基金证券账户的开立和使用,仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户,亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责,账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4、基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户,并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作,基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5、若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务,涉及相关账户的开立、使用的,若无相关规定,则基金托管人比照并遵守上述关于账户开立、使用的规定。

#### (五) 债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后,基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定,在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户,并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### (六) 其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户,可以根据法律法规和基金合同的规定,由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的,从其规定办理。

#### (七) 基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证由基金托管人存放于托管银行的保管库,也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库,保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让,由基金管理人和基金托管人共同办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### (八) 与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署,由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除协议另有规定外,基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时,应保证基金一方持有两份以上的正本,以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给基金托管人,并在十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### (一) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数,基金份额净值的计算,精确到 0.0001 元,小数点后第五位四舍五入,国家另有规定的,从其规定。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。

#### (二) 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。

(三) 根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### 六、基金份额持有人名册的保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册。如不能妥善保管,则按相关法规承担责任。

本基金份额持有人名册由基金管理人提供资料,由基金托管人按规定建立并保管。在基金托管人要求或编制半年报和年报前,基金管理人应将有关资料送交基金托管人,不得无故拒绝或延误提供,并保证其的真实性、准确性和完整性。

## 七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议,双方当事人应通过协商、调解解决,协商、调解不能解决的,任何一方将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,仲裁地点为北京市,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力,仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间,双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责,各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务,维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## 八、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### (一) 托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致,可以对协议进行修改。修改后的新协议,其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准后生效。

### (二) 基金托管协议终止出现的情形

- 1、本基金合同终止;
- 2、基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产;
- 3、基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权;
- 4、发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

## 第二十部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### 一、开户确认

基金管理人为投资者提供开户信息的短信确认及网上查询确认服务，投资者可通过接收公司的开户确认短信或者登录公司网站了解相关的开户信息。

### 二、资料寄送

#### (一) 基金投资人对账单

基金管理人为基金份额持有人提供对账单定期发送服务。

为保证基金份额持有人获得方便、快捷、私密性较强的对账单信息，基金管理人同时为基金份额持有人提供电子对账单发送服务。基金份额持有人在开户后可通过公司网站、客服电话、客服邮箱留下本人的电子邮件地址及相关信息，我们将按投资者的选择定期为其发送电子对账单。

#### (二) 其他资料

基金管理人将根据客户的定制要求和相应的客户类别，寄送公司期刊及各类研究报告，动态地向客户提供时效性强的财经资讯。

### 三、呼叫中心服务

东方呼叫中心已经开通并能为客户提供安全高效的信息查询服务及人工咨询服务。客户可以通过自动语音系统进行交易信息查询、账户信息查询与修改以及基金信息的查询，在这过程中客户有任何需要帮助的地方，均可以转接人工或在语音信箱中留言；系统同时受理 E-Mail 等多样化服务，为客户提供便捷多样的交流方式。

### 四、网上交易业务

本基金已开通网上交易业务，个人投资者可通过本基金管理人网上交易平台

办理本基金的开户、申购、赎回等各项业务,基金管理人在遵循法律法规的前提下开展网上交易申购费率优惠活动,个人投资者通过基金管理人网上交易平台办理本基金申购业务时可享受申购费率优惠,详情可登陆本公司网站 [www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com) 查阅基金管理人旗下基金开通网上交易业务的公告。

为方便个人投资者或基金份额持有人,未来在各项技术条件和准备完备的情况下,本基金管理人将酌情丰富网上交易渠道。

## 五、网上查询服务

通过本公司网站,客户还可获得如下服务:

### (一) 查询服务

所有东方开放式基金的持有人均可通过公司网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

### (二) 信息资讯服务

客户可以利用公司网站获取基金和公司的各类信息,包括基金的法律文件、业绩报告及公司最新动态等各类最新资料。

## 六、短信服务

通过短信向投资者发送本公司基金、公司活动等内容的相关信息。

## 七、资讯服务

投资者如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息,可拨打本公司如下电话:

电话呼叫中心:010-66578578 或 400-628-5888,该电话可转人工座席。

传真:010-66578700

## 八、红利再投资

本基金收益分配时,基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金,如果基金份额持有人选择将所获红利再投资于本基金,份额登记机构将其所获红利按红利发放日前一工作日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收

申购费用。

## 九、定期定额投资业务

为方便投资者或基金份额持有人，本基金已在部分销售机构开通定期定额投资业务，具体内容详见基金管理人和其他销售机构有关基金定期定额投资的公告。未来在各项技术条件和准备完备的情况下，将在其它销售渠道酌情增加本基金的定期定额投资业务。

## 十、基金转换

为方便基金份额持有人，本公司已在部分销售机构开通本基金和旗下各只基金的基金转换业务。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定以基金管理人对外发布的公告为准。

## 十一、客户投诉受理服务

基金份额持有人可以通过客户服务热线（010-66578578）（400-628-5888）、公司网站（[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)）（[www.df5888.com](http://www.df5888.com)）、电子邮件（[services@orient-fund.com](mailto:services@orient-fund.com)）、传真（010-66578700）、信件等方式对我们的工作提出建议或意见。我们将用心倾听投资者的需求和意见，并以最快的速度做出答复。

## 十二、投资顾问服务

本公司拥有一支具有金融专业技能与良好沟通技能的专业的理财顾问团队，分布于北京、上海、深圳等地区，致力于为客户提供优异的个性化理财服务。

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

电子信箱：[services@orient-fund.com](mailto:services@orient-fund.com)



## 第二十一部分 其他应披露事项

一、在本基金存续期内，本基金管理人的内部机构设置、职能划分可能会发生变化，职能也会相应地做出调整，但不会影响本基金的投资理念、投资目标、投资范围和投资运作。

二、基金管理人和基金份额持有人应遵守《东方基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》等有关规定(包括本基金管理人对上述规则的任何修订和补充)。上述规则由本基金管理人制定，并由其解释与修改。本基金托管人不受《东方基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》的限定。

三、本招募说明书将按中国证监会有关规定定期进行更新；招募说明书解释与基金合同不一致时，以基金合同为准。

四、从上次《招募说明书(更新)》截止日2017年12月3日到本次《招募说明书(更新)》截止日2018年6月3日之间的信息披露事项。

公告名称	公告日期
关于旗下部分基金继续参与中金公司开展的基金费率优惠活动的公告	2017-12-20
关于旗下部分基金参加邮储银行个人网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	2017-12-29
关于旗下基金参与中国工商银行“2018倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	2017-12-29
关于旗下部分基金继续参与交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	2017-12-29
东方基金管理有限责任公司年度最后一日基金净值公告	2018-1-2
关于旗下部分基金参与中国农业银行基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	2018-1-4
东方策略成长混合型开放式证券投资基金招募说明书(更新)(2017年第2号)	2018-1-16
东方策略成长混合型开放式证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2017年第2号)	2018-1-16
东方策略成长混合型开放式证券投资基金2017年第4季度报告	2018-1-19
关于旗下部分基金继续参与中泰证券开展的基金费率优惠活动的公告	2018-1-29
关于在中信银行开通旗下部分基金转换业务的公告	2018-3-17
关于在申万宏源西部证券开通旗下基金转换业务的公告	2018-3-21
关于旗下部分基金参与东海证券开展的基金费率优惠活动的公告	2018-3-30
东方策略成长混合型开放式证券投资基金2017年年度报告摘要	2018-3-30

东方策略成长混合型开放式证券投资基金 2017 年年度报告	2018-3-30
关于旗下部分基金继续参与交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	2018-3-31
关于继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	2018-3-31
东方基金管理有限责任公司关于旗下部分基金根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修订基金合同及托管协议的公告	2018-3-31
东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金合同(2018年3月31日修订)	2018-3-31
东方策略成长混合型开放式证券投资基金托管协议(2018年3月31日修订)	2018-3-31
关于在中信证券(山东)开通旗下基金定投业务的公告	2018-4-17
东方策略成长混合型开放式证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	2018-4-19

## 第二十二部分 招募说明书的存放及查阅方式

本《招募说明书》公布后，置备于基金管理人的住所，供公众查阅、复制。  
基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 第二十三部分 备查文件

以下备查文件分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所，供公众查阅、复制。

- 一、中国证监会批准东方策略成长股票型开放式证券投资基金募集的文件
- 二、《东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金合同》
- 三、《东方策略成长混合型开放式证券投资基金托管协议》
- 四、《东方策略成长混合型开放式证券投资基金法律意见书》
- 五、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

东方基金管理有限责任公司

2018年7月