

东方合家保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

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

东方合家保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2016 年 4 月 6 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东方合家保本混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]688 号）准予募集注册。本基金基金合同于 2016 年 6 月 16 日生效。

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

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

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

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

对象与投资策略引致的本基金的特有风险，等等。

本基金为保本混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金和债券型基金，但低于股票型基金、非保本混合型基金，属于低风险水平的投资品种。

本基金将股指期货纳入到投资范围中，股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。同时，股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给基金净值带来重大损失。

投资者投资于保本基金并不等于将基金作为存款放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在损失投资本金的风险。

投资人购买本基金份额的行为视为同意保证合同或风险买断合同的约定。

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

有关财务数据和净值表现截止日为2016年9月30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2016年12月16日。

一、基金合同生效日期

2016年6月16日

二、基金管理人

（一）基本情况

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层

办公地址：北京市西城区锦什坊街28号1-4层

邮政编码：100033

法定代表人：崔伟

成立时间：2004年6月11日

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

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服务；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

联系人：李景岩

电话：010—66295888

股权结构：

股东名称 出资金额（人民币） 出资比例

东北证券股份有限公司 12,800 万元 64%

河北省国有资产控股运营有限公司 5,400 万元 27%

渤海国际信托股份有限公司 1,800 万元 9%

合 计 20,000 万元 100%

内部组织结构：

股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会，董事会下设合规与风险控制委员会、薪酬与考核委员会；公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制，下设风险控制委员会、投资决策委员会、产品委员会、IT 治理委员会和权益投资部、固定收益部、量化投资部、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、电子商务部、财务部、人力资源部、综合管理部、董事会办公室、风险管理部、监察稽核部十八个职能部门及上海分公司、北京分公司、广州分公司；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

1、董事会成员

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

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

何俊岩先生，董事，硕士，高级会计师、中国注册会计师、中国注册资产评估师，吉

林省五一劳动奖章获得者。历任吉林省五金矿产进出口公司计划财务部财务科长，东北证券有限责任公司计划财务部总经理、客户资产管理总部总经理，福建凤竹纺织科技股份有限公司财务总监，东北证券有限责任公司财务部负责人、财务总监，东北证券股份有限公司副总裁兼财务总监，东证融达投资有限公司董事，东证融通投资管理有限公司董事，东方基金管理有限责任公司监事会主席；现任东北证券股份有限公司总裁、董事，兼任吉林省总会计师协会副会长，吉林省证券业协会副会长，渤海期货股份有限公司董事。

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

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

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

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

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

2、监事会成员

赵振兵先生，监事会主席，本科，高级经济师。历任河北华联商厦部门助理、副经理、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企业管理部副部长、资产运营部部长；现任河北省国有资产控股运营有限公司副总裁、河北省国控矿业开发投资有限公司董事。

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。

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

3、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，吉林大学行政管理硕士。历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，曾任总经理助理兼市场总监、市场部经理、公司副总经理。

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

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

4、本基金基金经理

姓名 任职时间 简历

李仆

（先生） 2016年6月16日

至今16年证券从业经历，曾任宝钢集团财务有限责任公司投资经理、宝钢集团有限公司投资经理、宝岛（香港）贸易有限公司投资部总经理、华宝信托有限责任公司资管部投资副总监、信诚基金管理有限公司基金经理。2014年2月加盟东方基金管理有限责任公司，现任公司总经理助理、固定收益部总经理、投资决策

委员会委员、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方永润 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方稳定增利债券型证券投资基金基金经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理、东方臻馨债券型证券投资基金基金经理、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

王然

（女士） 2016 年 6 月 16 日

至今 北京交通大学产业经济学硕士，8 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 日更名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 日更名为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理，现任东方保本混合型开放式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、东方赢家保本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、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理。

吴萍萍（女士） 2016 年 6 月 17 日

至今 中国人民大学应用经济学硕士，5 年证券从业经历，曾任安信证券投资组资金交易员、民生加银基金管理有限公司专户投资经理。2015 年 11 月加盟东方基金，曾任东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理助理、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理助理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理助理，现任东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理、东方永兴 18 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

刘鸿鹏先生，总经理、投资决策委员会主任委员，简历请参见高级管理人员介绍。

李仆先生，公司总经理助理、固定收益部总经理、投资决策委员会副主任委员。

简历请参见基金经理介绍。

刘志刚先生，量化投资部总经理、投资决策委员会委员，东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金经理。吉林大学数量经济学博士，8年证券从业经历。曾任工银瑞信基金管理有限公司产品开发部产品开发经理、安信基金管理有限责任公司市场部副总经理兼产品开发总监。2013年5月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任指数与量化投资部总经理、专户业务部总经理、产品开发部总经理、投资经理、东方央视财经50指数增强型证券投资基金（自2015年12月3日起转型为东方启明量化先锋混合型证券投资基金）基金经理。

朱晓栋先生，对外经济贸易大学经济学硕士，7年证券从业经历。2009年12月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任研究部金融行业、固定收益研究、食品饮料行业、建筑建材行业研究员，东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方核心动力股票型开放式证券投资基金（于2015年7月31日更名为东方核心动力混合型证券投资基金）基金经理。权益投资部副总经理、投资决策委员会委员，东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方区域发展混合型证券投资基金基金经理。

徐昫君先生，对外经济贸易大学金融学硕士，CFA，FRM，8年证券从业经历。曾任安信证券资产管理部研究员、投资经理，华西证券资产管理部投资经理。2013年3月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理助理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方永润18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。固定收益部总经理助理，投资决策委员会委员，东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理、东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系

三、基金托管人

（一）基本情况

1、基本情况概述

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：王洪章

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）。

2015 年末，本集团资产总额 18.35 万亿元，较上年增长 9.59%；客户贷款和垫款总额 10.49 万亿元，增长 10.67%；客户存款总额 13.67 万亿元，增长 5.96%。净利润 2,289 亿元，增长 0.28%；营业收入 6,052 亿元，增长 6.09%，其中，利息净收入增长 4.65%，手续费及佣金净收入增长 4.62%。平均资产回报率 1.30%，加权平均净资产收益率 17.27%，成本收入比 26.98%，资本充足率 15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达 1.45 万个，综合营销团队 2.15 万个，综合柜员占比达到 88%。启动深圳等 8 家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 95.58%，较上年提升 7.55 个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量 8,074 万张，消费交易额 2.22 万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产 1,000 万以上的私人银行客户数量增长 23.08%，客户金融资产总量增长 32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销 5,316 亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模 7.17 万亿元，增长 67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获

突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计122项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志2015年“世界银行品牌1000强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志2015年度全球企业2000强中位列第二。

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。

2、主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，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。

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。

3、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、QFII、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 2016 年一季度末，中国建设银行已托管 584 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。中国建设银行自 2009 年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

（二）基金托管人的内部控制制度说明

1、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。

2、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。资产托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

3、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

1、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“托管业务综合系统——基金监督子系统”，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，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。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。

2、监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，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，并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。

四、相关服务机构

(一) 直销机构

1、柜台交易

名称：东方基金管理有限责任公司直销中心

住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

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 或 www.df5888.com

2、电子交易

投资者可以通过基金管理人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基金管理人网站查询。

网址：www.orient-fund.com 或 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：王洪章

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

2、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

客户服务电话：95559 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：www.95559.com.cn

3、兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市江宁路 168 号兴业大厦 9 楼

法定代表人：高建平

联系人：刘玲

电话：021-52629999

传真：021-62569070

客户服务电话：95561

网址：www.cib.com.cn

4、中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表：唐双宁

联系人：朱红

电话：010-63636153

传真：010-63639709

客户服务电话：95595

网址：www.cebbank.com

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

客户服务电话：95588

网址：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

联系人：刘健

电话：010-57092637

传真：010-57092611

客户服务电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

7、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：王硕

传真：010-68858117

客户服务电话：95580

网址：www.psbc.com

8、招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83077278

传真：0755-83195109

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

9、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

客户服务电话：95558

网址：bank.ecitic.com

10、长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

联系人：奚博宇

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

网址：www.95579.com

11、东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市净月开发区生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

联系人：潘锴

电话：0431-85096709

客户服务电话：4006000686

网址：www.nesc.cn

12、东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

联系人：梁旭

电话：021-20333333

传真：021-50498825

客户服务电话：95531 或 400-888-8588

网址：www.longone.com.cn

13、东莞证券股份有限公司

住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 30 楼

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

联系人：孙旭

电话：0769-22119348

客户服务电话：961130（省内直拨，省外请加拨区号 0769）

网址：www.dgzq.com.cn

14、光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号 3 楼

法定代表人：薛峰

联系人：李芳芳

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：95525

网址：www.ebscn.com

15、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/朱雅崑

电话：021-38676161

传真：021-38670161

客户服务电话：95521

网址：www.gtja.com

16、海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

电话：021-23219275

传真：021-23219100

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

网址：www.htsec.com

17、华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：李工

联系人：甘霖

电话：0551-65161666

传真：0551-5161600

客户服务电话：95318 或 4008096518

网址：www.hazq.com

18、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（深圳）

客户服务电话：95597

网址：www.htsc.com.cn

19、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：上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人：俞洋

联系人：王道

电话：021-64339000

传真：021-54967293

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

网址：www.cfsc.com.cn

20、江海证券有限公司

住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：刘爽

电话：0451-85863719

传真：0451-82287211

客户服务热线：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

21、联讯证券股份有限公司

住所：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层

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

法定代表人：徐刚

联系人：陈思

电话:021-33606736

传真: 021-33606760

客户服务电话: 95564

网址: www.lxzq.com.cn

22、上海证券有限责任公司

住所: 上海市黄浦区西藏中路 336 号

办公地址: 上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人: 龚德雄

联系人: 张向纯

电话: 021-53686888

传真: 021-53686100, 021-53686200

客户服务电话: 021-962518

网址: www.962518.com

23、山西证券股份有限公司

住所: 山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址: 山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人: 侯巍

联系人: 郭熠

电话: 0351-8686659

传真: 0351-8686619

客户服务电话: 400-666-1618

网址: www.i618.com.cn

24、申万宏源证券有限公司

住所: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人: 李梅

联系人: 曹晔

电话: 021-33388215

传真: 021-33388224

客户服务电话: 95523 或 4008895523

网址: www.swhysc.com

25、五矿证券有限公司

住所: 深圳市福田区金田路 4028 号经贸中心 48 楼

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号经贸中心 48 楼

法定代表人：赵立功

联系人：马国栋

电话：0755-83252843

传真：0755-82545500

客户服务电话：40018-40028

网址：www.wkzq.com.cn

26、兴业证券股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-68419393-1098

传真：021-68419867

客户服务电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

27、招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林迎生

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客户服务电话：95565、4008881111

网址：www.newone.com.cn

28、中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

联系人：宋明

电话：010-66568450

传真：010-66568990

客户服务电话：400-888-8888

网址: www.chinastock.com.cn

29、中山证券有限责任公司

住所: 深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层

办公地址: 深圳市华侨城深南大道9010号

法定代表人: 黄扬录

联系人: 罗艺琳

电话: 0755-82570586

传真: 0755-82960582

客户服务电话: 4001-022-011

网址: www.zszq.com

30、中信建投证券股份有限公司

住所: 北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址: 北京市朝阳区门内大街188号

法定代表人: 王常青

联系人: 权唐

电话: 010-85130588

传真: 010-65182261

客户服务电话: 400-8888-108

网址: www.csc108.com

31、中信证券(山东)有限责任公司

住所: 青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

办公地址: 青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层, 266071

法定代表人: 杨宝林

联系人: 吴忠超

电话: 0532-85022326

传真: 0532-85022605

客户服务电话: 95548

网址: www.zxwt.com.cn

32、中信证券股份有限公司

住所: 广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

办公地址: 北京朝阳区亮马桥路48号

法定代表人: 王东明

联系人: 陈忠

电话：010-60838888

传真：010-60833799

客户服务电话：95548

网址：www.ecitic.com

33、中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-

1305室、14层

办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-

1305室、14层

法定代表人：张皓

联系人：洪诚

电话：0755-23953913

传真：0755-83217421

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

34、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：余永健

电话：010-85097570

传真：010-85097308

客户服务电话：400-021-8850

网址：www.harvestwm.cn

35、上海中正达广投资管理有限公司

住所：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

联系人：戴珉微

电话：021-33768132

传真：021-33768132*802

客户服务电话：400-6767-523

网址：www.zzwealth.cn

36、中国国际金融股份有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇

电话：010-65051166

传真：010-85679203

客户服务电话：400-910-1166

网址：www.cicc.com.cn

37、平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

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

法定代表人：谢永林

联系人：周一涵

电话：021-38637436

传真：021-58991896

客户服务电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

38、奕丰金融服务（深圳）有限公司

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

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

法定代表人：TAN YIK KUAN

联系人：陈广浩

电话：0755-89460506

传真：0755-21674453

客户服务电话：400-684-0500

网址：www.ifastps.com.cn

39、东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-66555147

客户服务电话：400-888-8993

网址：www.dxzq.net

40、国金证券股份有限公司

住所：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

传真：028-86690126

客户服务电话：95310

网址：www.gjzq.com.cn

41、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

42、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

43、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

44、深圳众禄基金销售有限公司

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 及 www.jjmmw.com

45、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

46、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

47、北京展恒基金销售股份有限公司

住所: 北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

办公地址: 北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人: 闫振杰

联系人: 宋丽冉

电话: 010-62020088

传真: 010-62020355

客户服务电话: 400 888 6661

网址: <http://www.myfund.com>

48、北京钱景财富投资管理有限公司

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

公司网址: www.niuji.net

49、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所: 深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址: 北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼东翼 7 层
727 室

法定代表人: 杨懿

联系人: 张燕

电话: 010-58325388-1588

传真: 010-58325282

客服电话: 400-166-1188

网址: [https:// 8.jrj.com.cn](https://8.jrj.com.cn)

50、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

公司网站：www.5ifund.com

51、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

52、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：沈继伟

联系人：赵沛然

电话：021-50583533

传真：021-50583633

客服电话：400 067 6266

网址：www.leadfund.com.cn

53、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

网站：www.chtfund.com

54、上海陆金所资产管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

联系电话：021-20665952

传真：021-22066653

客服：4008219031

网站：www.lufunds.com

55、北京乐融多源投资咨询有限公司

住所：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

办公地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层

法定代表人：董浩

联系人：牛亚楠

联系电话：18610807009

传真：010-65951887

客服：400-068-1176

网站：www.jimufund.com

56、上海汇付金融服务有限公司

住所：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

联系人：陈云卉

联系电话：021-33323999-5611

传真：021-33323837

客服：400-820-2819

网址：<http://www.chinapnr.com/>

57、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼

法定代表人：汪静波

联系人：李娟

联系电话：021-38509735

传真：021-38509777

客服：400-821-5399

网址：<http://www.noah-fund.com/>

58、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

59、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

60、大泰金石投资管理有限公司

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

61、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

62、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

63、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

64、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

65、乾道金融信息服务（北京）有限公司

住所：北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室
办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室
法定代表人：王兴吉
联系人：高雪超
联系电话：010-62062880
传真：010-82057741
客服：400-088-8080
网址：www.qiandaojr.com

3、登记机构

名称：东方基金管理有限责任公司
住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层
办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层
法定代表人：崔伟
联系人：王骁骁
电话：010-66295873
传真：010-66578680
网址：www.orient-fund.com 或 www.df5888.com

4、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
负责人：俞卫锋
联系人：陆奇
电话：021-31358666
传真：021-31358600
经办律师：黎明、陆奇

5、审计基金财产的会计师事务所

名称：立信会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市南京东路 61 号新黄浦金融大厦 4 层
办公地址：北京市海淀区西四环中路 16 号院 7 号楼 10 层
法定代表人：朱建弟
联系人：朱锦梅
电话：010-68286868

传真：010—88210608

经办注册会计师：朱锦梅、赵立卿

五、基金名称和基金类型

（一）本基金名称：东方合家保本混合型证券投资基金

（二）本基金类型：混合型

基金运作方式：契约型，开放式

六、基金投资目标和投资方向

（一）投资目标

运用保本策略，通过动态调整股票与债券等资产的组合，在有效控制投资风险、确保保本周期内本金安全的前提下，力求实现基金资产的长期稳定增值。

（二）投资范围

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

本基金将主要根据 CPPI 固定比例投资组合保险策略，将投资对象主要分为固定收益类资产和权益类资产两类，并动态调整两类资产的投资比例，从而达到防御下跌、实现增值的目的。其中，固定收益类资产包括国债、中央银行票据、地方政府债、金融债（含政策性金融债）、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具；权益类资产包括股票、权证、可转换债券（含可分离交易可转债）等权益类资产。

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

基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例不高于 40%，固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%。本基金持有现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

七、基金的投资策略

本基金运用 CPPI 固定比例投资组合保险机制，动态分配基金资产在权益类资产和固定收益类资产上的投资比例。

1、保本期投资策略

（1）大类资产配置策略

CPPI 组合保险机制的核心思想是将本金投入到固定收益类资产和权益类资产，通过投资固定收益类资产实现保本目标，投资权益类资产谋求本金的增值。

其中，固定收益类资产主要投资于到期日小于或与保本周期到期日相当的国债、企业债与金融债等低权益类资产，确保基金在保本周期到期时，基金资产实现本金安全的目标；权益类资产以投资于股票、权证等较高风险类资产博取更高的投资收益。

CPPI 策略的基本公式可表达为： $E=M \times (A-F)$

其中：

E = 权益类资产可投资额度

A = 基金资产总值

F = 最低保证额度（本基金为 100%）的折现值

M 为风险乘数， $M \geq 1$

$A-F$ 被称为缓冲额度或安全垫

基于此，以 CPPI 策略进行大类资产配置时，需要计算 F 和 M 的值。

1) 最低保证额度折现值 F 的确定

F 主要根据保本周期内固定收益工具的收益率水平和距离保本周期的剩余期限来确定。在保本周期内，随着距离保本周期的剩余期限的缩小， F 值逐步向上调整，直至达到 100%。

2) 风险乘数 M 的确定

本基金基金管理人将基于保本周期内中国经济运行周期的变动和证券市场的风险特征，确定风险乘数 M ，并经投资决策委员会审核，通过控制风险乘数 M 的大小，动态调整本基金在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例。

为了能够更有效地运用 CPPI 组合保险机制，灵活地将基金资产分配于权益类资产和固定收益类资产两个市场中，使其能够充分分享股票市场和债券市场在不同时期的投资机会，并确保在证券市场出现剧烈波动时，依然有机会实现保本增值的目标，本基金将保持风险乘数处于一个合理的区间。

此外，CPPI 的核心思想是充分利用安全垫来进行操作，以前期基金收益作为后期风险投资的损失上限，乘以风险乘数后，作为权益类资产投资的上限。随着安全垫的增厚，增加对权益类资产的投资，适当减少对固定收益类资产的投资；随着安全垫的变薄，减少对权益类资产的投资，同时增加对固定收益类资产的投资。

（2）固定收益类资产的投资策略

本基金对固定收益类资产的配置主要为未来现金流稳定、风险可预期的固定收益工具。本基金将通过持有相当数量剩余期限小于或者等于本基金保本周期（24个月）的债券并持有到期，以确保债券资产的稳定收益。对于此类债券，基金采取买入持有策略，追求获得稳定的利息支付和本金偿还。本基金本着风险收益配比最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的配置比例。

另外，在收益性和流动性的基础上，适量持有其他固定收益类证券。在实际的投资运作中，本基金将运用久期调整策略、收益率曲线策略、类属券种配置策略、期限结构策略等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。

1) 久期调整策略

本基金将根据对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，进而主动调整所持有的债券资产组合的久期值，达到增加收益或减少损失的目的。当预期市场总体利率水平降低时，本基金将延长所持有的债券组合的久期值，从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升所产生的资本利得；反之，当预期市场总体利率水平上升时，则缩短组合久期，以避免债券价格下降的风险带来的资本损失，获得较高的再投资收益。

2) 期限结构策略

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

3) 类属资产配置策略

根据资产的发行主体、风险来源、收益率水平、市场流动性等因素，本基金将市场主要细分为一般债券（含国债、央行票据、政策性金融债等）、信用债券（含公司债券、企业债券、非政策性金融债券、短期融资券、地方政府债券、资产支持证券等）、附权债券（含可转换公司债券、可分离交易公司债券、含回售及赎回选择权的债券等）三个子市场。在大类资产配置的基础上，本基金将通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求状况、信用风险状况等因素进行综合分析，在目标久期控制及期限结构配置基础上，采取积极投资策略，确定类属资产的最优配置比例。

（3）权益类资产的投资策略

本基金通过定量分析和定性分析相结合的方式选择具有较高投资价值的股票。定量分析主要依据上市公布的相关数据等，通过对主营业务收入增长率、净利润等

相关指标的分析对公司的成长能力、盈利能力、未来发展潜力、股票估值水平等形成判断。

1) 成长能力分析

本基金认为，企业以往的成长性能够在一定程度上反映企业未来的增长潜力，因此，本基金利用主营业务收入增长率、净利润增长率、经营性现金流量增长率指标来考量公司的历史成长性，作为判断公司未来成长性的依据。

主营业务收入增长率是考察公司成长性最重要的指标，主营业务收入的增长所隐含的往往是企业市场份额的扩大，体现公司未来盈利潜力的提高，盈利稳定性的加大，公司未来持续成长能力的提升。本基金主要考察上市公司最新报告期的主营业务收入与上年同期的比较，并与同行业相比较。

净利润是一个企业经营的最终成果，是衡量企业经营效益的主要指标，净利润的增长反映的是公司的盈利能力和盈利增长情况。本基金主要考察上市公司最新报告期的净利润与上年同期的比较，并与同行业相比较。

经营性现金流量反映的是公司的营运能力，体现了公司的偿债能力和抗风险能力。本基金主要考察上市公司最新报告期的经营性现金流量与上年同期的比较，并与同行业相比较。

2) 盈利能力分析

本基金利用总资产报酬率、净资产收益率、盈利现金比率（经营现金净流量/净利润）指标来考量公司的盈利能力和质量。

总资产报酬率是反映企业资产综合利用效果的核心指标，也是衡量企业总资产盈利能力的重要指标；净资产收益率反映企业利用股东资本盈利的效率，净资产收益率较高且保持增长的公司，能为股东带来较高回报。本基金考察上市公司过去两年的总资产报酬率和净资产收益率，并与同行业平均水平进行比较。

盈利现金比率，即经营现金净流量与净利润的比值，反映公司本期经营活动产生的现金净流量与净利润之间的比率关系。该比率越大，一般说明公司盈利质量就越高。本基金考察上市公司过去两年的盈利现金比率，并与同行业平均水平进行比较。

此外，本基金还将关注上市公司盈利的构成、盈利的主要来源等，全面分析其盈利能力和质量。

3) 未来增长潜力分析

公司未来盈利增长的预期决定股票价格的变化。因此，在关注上市公司历史成长性的同时，本基金尤其关注其未来盈利的增长潜力。本基金将对上市公司未来一至三年的主营业务收入增长率、净利润增长率进行预测，并对其可能性进行判断。

4) 估值水平分析

本基金将根据上市公司所处的行业，采用市盈率、市净率等估值指标，对上市公司股票价值进行动态评估，分析该公司的股价是否处于合理的估值区间，以规避股票价值被过分高估所隐含的投资风险。

定性分析主要考察公司的资源配置、技术创新力、品牌竞争力、受国家政策影响程度等。

本基金综合上述条件筛选具有投资价值的个股，构建股票组合。

(4) 资产支持证券投资策略

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

(5) 股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

2、到期操作期间和过渡期的投资策略

到期操作期间和过渡期内，除暂时无法变现的基金财产外，本基金应使基金财产保持较高的流动性（如有无法变现的基金财产，如在到期操作期间和过渡期内具备变现条件，基金管理人可根据市场情况安排变现），持有现金、银行存款和到期日在一年以内的政府证券等。

八、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：两年期银行定期存款收益率（税后）

本基金保本周期为二十四个月。以“两年期银行定期存款收益率（税后）”为本基金的业绩比较基准能够较好地反映本基金的投资目标。

如果今后商业银行可以自由调整存款利率，基金管理人将与基金托管人协商确定基准利率。如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出时，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，但不需要召开基金份额持有人大会。

法律法规另有规定的，从其规定。

九、基金的风险收益特征

本基金为保本混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金和债券型基金，但低于股票型基金、非保本混合型基金，属于低风险水平的投资品种。

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 2016 年 9 月 30 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 53,458,992.80 6.05

其中：股票 53,458,992.80 6.05

2 基金投资 --

3 固定收益投资 789,067,527.50 89.34

其中：债券 789,067,527.50 89.34

资产支持证券 --

4 贵金属投资 --

5 金融衍生品投资 --

6 买入返售金融资产 --

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

7 银行存款和结算备付金合计 21,058,976.48 2.38

8 其他资产 19,673,449.71 2.23

9 合计 883,258,946.49 100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码 行业类别 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

A 农、林、牧、渔业 --

B 采矿业 --

C 制造业 46,217,419.62 6.08

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E	建筑业	7,224,711.56	0.95
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	16,861.62	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	53,458,992.80	7.04

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	600309	万华化学	200,000	4,112,000.00	0.54
2	601186	中国铁建	450,000	4,054,500.00	0.53
3	002236	大华股份	260,000	4,032,600.00	0.53
4	603866	桃李面包	90,000	3,805,200.00	0.50
5	600872	中炬高新	250,000	3,767,500.00	0.50
6	300429	强力新材	93,000	3,563,760.00	0.47
7	002444	巨星科技	200,000	3,470,000.00	0.46
8	600068	葛洲坝	400,000	3,164,000.00	0.42
9	600808	马钢股份	1,100,000	3,047,000.00	0.40
10	603818	曲美家居	150,000	3,046,500.00	0.40

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	---------	--------------

- 1 国家债券 --
- 2 央行票据 --
- 3 金融债券 80,122,000.00 10.54
- 其中：政策性金融债 80,122,000.00 10.54
- 4 企业债券 708,730,400.00 93.27
- 5 企业短期融资券 --
- 6 中期票据 --
- 7 可转债（可交换债） 215,127.50 0.03
- 8 同业存单 --
- 9 其他 --
- 10 合计 789,067,527.50 103.84

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 | 124410 | 13 国网 03 | 500,000 | 54,910,000.00 | 7.23 |
| 2 | 136559 | 16 华电 03 | 500,000 | 50,260,000.00 | 6.61 |
| 3 | 1280044 | 12 攀国投 | 400,000 | 46,256,000.00 | 6.09 |
| 4 | 160210 | 16 国开 10 | 400,000 | 40,156,000.00 | 5.28 |
| 5 | 136318 | 16 中油 05 | 400,000 | 40,132,000.00 | 5.28 |

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) 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

(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	37,235.61
2	应收证券清算款	66,138.12
3	应收股利	-
4	应收利息	19,570,075.98
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,673,449.71

(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
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十一、基金的业绩

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

(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

2016.6.16-2016.9.30 0.76% 0.08% 0.61% 0.01% 0.15% 0.07%

(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

注：本基金基金合同于2016年6月16日生效，截至报告期末，本基金合同生效

不满六个月，仍处于建仓期。

十二、费用概览

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

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

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费每日按前一日基金资产净值的 1.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

保本周期内，保证费用由基金管理人从基金管理费收入中列支。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费每日按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

上述“一、基金费用的种类中第 3—9 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十三、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《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》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动进行了更新，主要内容如下：

（一）在“重要提示”中，增加了“基金合同生效时间”、“招募说明书有关财务数据和财务净值的截止日期”、“其他内容的截止日期”。

（二）在“第三部分 基金管理人”中，对基金管理人的相关内容进行了更新。

（三）在“第四部分 基金托管人”中，对基金托管人的相关内容进行了更新。

（四）在“第五部分 相关服务机构”中，更新了其他销售机构的信息。

（五）将“基金的募集”与“基金合同生效”两个章节合并为第六部分“基金的募集与基金合同生效”，后续章节编码顺次调整。

（六）在“第十一部分 基金的投资”中，增加了“基金的投资组合报告”的内容，截止日期为 2016 年 9 月 30 日，该部分内容均按有关规定编制，并经本基金托管人复核，但未经审计。

（七）增加“第十二部分 基金的业绩”，该部分内容均按照有关规定编制，并经本基金托管人复核，但相关财务数据未经审计。

（八）在“第二十四部分 其他应披露事项”中，更新了从基金合同生效日2016年6月16日到本次《招募说明书（更新）》截止日2016年12月16日之间的信息披露事项。

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

东方基金管理有限责任公司

2017年1月