

东方大健康混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要

(2017 年第 1 号)

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

重要提示

东方大健康混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2015 年 7 月 13 日中国

证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东方大健康混合型证券投资

基金注册的批复》（证监许可[2015]1613 号）准予募集注册。本基金基金合同于 2016

年 2 月 4 日正式生效。

东方基金管理有限责任公司（以下简称“本基金管理人”）保证《东方大健康混合

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基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。

投资本基金可能遇到的风险包括：证券市场整体环境引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，大量赎回或暴跌导致的流动性风险，基金投资过程中产生的操作风险，因交收违约和投资债券引发的信用风险，基金投资对象与投资策略引致的特定风险，等等。

本基金对固定收益类资产的投资中将中小企业私募债券纳入到投资范围当中，中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市的中小企业以非公开方式发行的债券。该类债券不能公开交易，可通过上海证券交易所固定收益证券综合电子平台或深圳证券交易所综合协议交易平台进行交易。一般情况下，中小企业私募债券的交易不活跃，潜在流动性风险较大；并且，当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性限制，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券，从而可能给基金净值带来损失。本基金为混合型基金，属于证券投资基金中风险水平中等的基金品种，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金。

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

截至 2016 年 7 月 13 日，本基金出现基金资产净值持续 60 个工作日低于 5000 万元的情形。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，本基金管理人

已将上述情形向证监会进行备案。

有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 12 月 31 日（财务数据未经审计），
如无其

他特别说明，本招募说明书其他所载内容截止日为 2017 年 2 月 4 日。

一、基金合同生效日期

2016 年 2 月 4 日

二、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

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

联系人：李景岩

电话：010-66295888

股权结构：

股东名称	出资金额（人民币）	出资比例
------	-----------	------

东北证券股份有限公司	12,800 万元	64%
------------	-----------	-----

河北省国有资产控股运营有限公司	5,400 万元	27%
-----------------	----------	-----

渤海国际信托股份有限公司	1,800 万元	9%
--------------	----------	----

合计	20,000 万元	100%
----	-----------	------

内部组织结构：

股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会，董事会下设合规与风险控制

委员会、薪酬与考核委员会；公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制，

下设投资

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

东方基金管理有限责任公司监事会主席；现任东北证券股份有限公司总裁、董事，东证融

成资本管理有限公司董事长，东证融汇证券资产管理有限公司董事，渤海期货股份有限

公司董事，兼任中国证券业协会融资融券业务专业委员会委员，吉林省证券业协会副会

长。

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总局聘为首批餐饮

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，兼任监察稽核

部总经理。

肖向辉先生，监事，本科。曾任职北京市化学工业研究院、中国工商银行总行；现任

东方基金管理有限责任公司运营部执行总经理。

3、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。曾先后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

场总监和市场部经理、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，历任董办主

任、董秘、总经理助理等职务，期间曾兼任人力资源部、综合管理部、风险管理部等部门总

经理职务。

李景岩先生，督察长，硕士研究生，中国注册会计师。历任东北证券股份有限公司延

吉证券营业部财务经理、北京管理总部财务经理。2004年6月加盟本公司，历任财务主

管，财务部经理，财务负责人，综合管理部经理兼人力资源部经理、总经理助理。

4、本基金基金经理

姓名 任职时间 简历

薛子微

(先生)

2016年12月27日至

今

山西大学工商管理、应用心理学专业学士，10年证券从业经历。曾任中宣部政研所研究员、中信基金管理有限责任公司助理研究员、华夏基金管理有限公司研究员。2009年7月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任权益投资部房地产、综合、汽车、国防军工、机械设备行业研究员，投资经理、东方核心动力股票型开放式证券投资基金（于2015年7月31日更名为东方核心动力混合型证券投资基金）基金经理。现任东方增长中小盘混合型开放式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、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方新价值混合型证券投资基金基金经理、东方互联网嘉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、东方大健康混合型证券投资基金基金经理。

邱义鹏

(先生) 2016年2月4日至2017年1月19日任本基金基金经理

5、投资决策委员会成员

刘鸿鹏先生，总经理，投资决策委员会主任委员，简历请参见高级管理人员介绍。

李仆先生，公司总经理助理，投资决策委员会副主任委员、东方双债添利债券型证券

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，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。 17 年证券从业经历，
历任宝

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，曾任特别顾问，固定
收益部总

经理。

刘志刚先生，量化投资部总经理，东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金经
理，

投资决策委员会委员。 吉林大学数量经济学博士，9 年基金从业经历。 历任工
银瑞信基

金管理有限公司产品开发部产品开发经理、安信基金管理有限责任公司市场部副
总经理

兼产品开发总监。 2013 年 5 月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任指数与量
化投资部

总经理、专户业务部总经理、产品开发部总经理、东方央视财经 50 指数增强型
证券投资

基金（自 2015 年 12 月 3 日起转型为东方启明量化先锋混合型证券投资基金）基
金经理。

朱晓栋先生，对外经济贸易大学经济学硕士，8 年证券从业经历。 2009 年 12 月
加盟

东方基金管理有限责任公司，曾任研究部金融行业、固定收益研究、食品饮料行
业、建筑

建材行业研究员，东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方精选混
合型开

放式证券投资基金基金经理、东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金经理。

现任

权益投资部副总经理、投资决策委员会委员、东方利群混合型发起式证券投资基
金基金

经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混

合型证

券投资基金基金经理、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理、东方鼎新灵活配置

混合型证券投资基金基金经理、东方核心动力混合型证券投资基金基金经理、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经

理、东方区域发展混合型证券投资基金基金经理。

徐昀君先生，固定收益部副总经理、投资决策委员会委员。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，曾任固定收

益部总经理助理，东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理助理、东方稳健回报

债券型证券投资基金基金经理助理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、

东方永润18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。现任东方稳健回报债券型证

券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配

置混合型证券投资基金基金经理、东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理、东方臻享

纯债债券型证券投资基金基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称“中国农业银行”）

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 成立日期：2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经

国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网

点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服

务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业

银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。

作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以

客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的

电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共

创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业

绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银

行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告。自2010年

起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立

公正第

三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2015 年连续三年荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理处、证券投资基金托管处、委托资产托管处、境外资产托管处、保险资产托管处、风险管理处、技术保障处、营运中心、市场营销处、内控监管处、账户管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 140 名，其中具有高级职称的专家 30 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到 2016 年 12 月 31 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 349 只。

（二）基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,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

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风

险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专

职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

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;业务管理实行严

格的复核、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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投

资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,

并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基

金管理人进行提示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面

提示有关基金管理人并报中国证监会。

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 法定代表人：崔伟

办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 3 层

联系人：孙桂东

电话：010—66295921

传真：010—66578690

网址：www.orient-fund.com 或 www.df5888.com

2、电子交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理基金的申购、赎回等业务，具体业务办理

情况及业务规则请登录本公司网站查询。

网址：www.orient-fund.com 或 www.df5888.com

（二）其他销售机构

1、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：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

2、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

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

客户服务电话：400-88-96666(全国)、96666(吉林省)

网址：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

5、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

6、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

7、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

8、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

9、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

10、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

11、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

12、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

13、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

14、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 15、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

16、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

17、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

18、中泰证券股份有限公司

住所：济南市经七路 86 号

办公地址：济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客户服务电话：95538

网址：www.zts.com.cn

19、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

20、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

21、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

22、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

23、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

24、招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

联系人：林迎生

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

客户服务电话：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

25、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

26、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

27、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

28、中信证券（山东）有限责任公司 住所：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融中心 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

29、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

30、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 31、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

32、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

33、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

34、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

35、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

36、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

37、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.gjqz.com.cn

38、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）

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

39、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

网站：www.buyfunds.cn

40、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

41、深圳众禄金融控股股份有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

客户服务电话：400 678 8887 网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

42、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

43、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

44、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>

45、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 010-57418829

传真：010-57569671

客服电话：400 678 5095

公司网址：www.niuji.net

46、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>

47、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

48、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

49、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

50、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

51、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

52、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

53、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/>

54、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: 张裕

联系电话: 021-38509735

传真: 021-38509777

客服: 400-821-5399

网址: <http://www.noah-fund.com/>

55、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

56、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

57、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

58、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

59、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

60、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 61、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 62、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 63、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

（三）登记机构

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

办公地址：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

法定代表人：崔伟

联系人：王骁骁 电话：010-66295873

传真：010-66578680 网址：www.orient-fund.com 或 www.df5888.com

（四）出具法律意见书的律师事务所

名称：北京德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融大街 19 号富凯大厦 B 座 12 层

办公地址：北京市西城区金融大街 19 号富凯大厦 B 座 12 层

负责人：王丽

联系人：刘焕志

电话：010—52682888 传真：010—52682999

经办律师：刘焕志、孙艳利

（五）审计基金财产的会计师事务所

名称：立信会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市南京东路 61 号新黄浦金融大厦 4 层

办公地址：北京市海淀区西四环中路 16 号院 7 号楼 10 层

法定代表人：朱建弟

联系人：朱锦梅

电话：010-68286868

传真：010-88210608

经办注册会计师：朱锦梅、赵立卿

五、基金名称和基金类型

（一）本基金名称：东方大健康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

以我国健康产业为核心投资方向，筛选具有投资价值的优质企业，通过健康产业内各行业的灵活配置分享我国大健康产业发展带来的投资机遇。

（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（包括创业板股票、中小板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中

小企业私募债）、资产支持证券、货币市场工具、股指期货与权证等金融衍生工具以及

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）。

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：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；投资于本基金定义的健康产业的证券资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；任何交易日日终在

扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不

低于基金资产净值的 5%。

七、基金的投资策略

1、大类资产配置

本基金从国际化视野审视中国经济和资本市场，全面分析影响股票市场和债券市场走势的各种因素，深入详细地评估股票市场和债券市场的运行趋势。根据影响证券

市场运行的各种因素的变化趋势，及时调整大类资产的配置比例，控制系统性风险。

在大类资产配置过程中，本基金主要应用 MVPS 模型，即综合考虑宏观经济因素、市场

估值因素、政策因素、市场情绪因素等因素的影响来进行大类资产配置。

（1）宏观经济因素。主要分析对证券市场的基本面产生普遍影响的宏观经济指标。包括：GDP 增长率、工业增加值、CPI、PPI 水平及其变化趋势、市场利率水平及其变化趋势、M1、M2 值及其增加量等；

（2）市场估值因素。包含纵向比较股票市场的整体估值水平、横向比较股票、债券之间的相对收益水平、上市公司盈利水平及其盈利预期、市场资金供求关系变化等；

（3）政策因素。研究与证券市场紧密相关的各种宏观调控政策，包括产业发展政策、区域发展政策、货币政策、财政政策、房地产调控政策等；

（4）市场情绪因素，包含新开户数、股票换手率、市场成交量、开放式基金股票持仓比例变化等。综合上述因素的分析结果，本基金给出股票、债券和货币市场工具等资产的最佳

配置比例并实时进行调整。

2、股票投资策略
本基金灵活运用多种投资策略，多维度分析股票的投资价值，充分挖掘市场中潜在的投资机会，实现基金的投资目标。

(1) 健康产业的界定 本基金定义的健康产业是与国民健康状况提升、改善和恢复直接或间接相关产业

的统称。 健康产业可细分为下述子产业（各子产业相关行业可能出现交叉）：

①医疗保健产业，指与国民健康恢复、疾病的预防和治疗、日常健康状况监测、医

疗保健设备制造相关的产业。 参考中信证券行业分类，相关行业包括但不限于生物医

药、医疗器械、医疗服务、电子设备等；

②国民身心健康产业，指与国民身体素质提高和精神文明建设相关的产业。 与国民身体素质提高相关的行业包括为国民健身运动提供健身器械、运动服装、户外运动

设备、运动场地的行业，此外，赞助和支持全民体育赛事的公司也纳入与国民身体素质

提高相关的范围；国民精神文明建设相关的行业包括图书、报刊、影音、游戏（含手

游）、动漫、旅游等。 参考中信证券行业分类，所属行业包括但不限于电影动画、餐饮旅

游、互联网、平面媒体等；

③环境改善产业，指生态环境改善（如空气治理、新能源技术、节能设备等）、营养

与保健食品、家居环境改善相关的产业。 参考中信证券行业分类，相关行业包括但不限于

环保及公用事业、电子设备、汽车、食品材料、农林牧渔、家电等；

④国民养老产业，指根据年龄阶段、心理状态、经济基础、社会发展文明等差异背

景，针对未来有养老需求的个体或老年群体提供生命保障服务和产品的产业。

相关行

业与医疗保健产业有所重合外，还包括民营医疗、食品、保险等行业。

如果居民需求变化和行业发展趋势导致本基金定义的健康产业范围发生变化，本基金将在深入研究的基础之上，适时将变动行业内的公司股票纳入本基金健康产业的

界定范围。

(2) 个股配置策略

①成长能力较强

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，主营业务收入的增加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盈利质量较高

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未来增长潜力强

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。

3、债券投资策略

（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。

①一般债券投资策略

在目标久期控制及期限结构配置基础上，对于国债、中央银行票据、政策性金融债，本基金主要通过跨市场套利等策略获取套利收益。同时，由于国债及央行票据具有良好的流动性，能够为基金的流动性提供支持。

②信用债券投资策略

信用评估策略：信用债券的信用利差与债券发行人所在行业特征和自身情况密切相关。本基金将通过行业分析、公司资产负债分析、公司现金流分析、公司运营管理分析等调查研究，分析违约风险即合理的信用利差水平，对信用债券进行独立、客观的价值评估。

回购策略：回购放大是一种杠杆投资策略，通过质押组合中的持仓债券进行正回购，将融得资金购买债券，获取回购利率和债券利率的利差，从而提高组合收益水平。

影响回购放大策略的关键因素有两个：其一是利差，即回购资金成本与债券收益率的关系，只有当债券收益率高于回购资金成本时，放大策略才能取得正的回报；其二是债券的资本利得，所持债券的净价在放大操作期间出现上涨，则可以获取价差收益。

在收益率曲线陡峭或预期利率下行的市场情况下，在防范流动性风险的基础上，适当运用回购放大策略，可以为基金持有人争取更多的收益。

③附权债券投资策略

本基金在综合分析可转换公司债券的债性特征、股性特征等因素的基础上，利用

BS 公式或二叉树定价模型等量化估值工具评定其投资价值，重视对可转换债券对应股

票的分析与研究，选择那些公司和行业景气趋势回升、成长性好、安全边际较高的品种

进行投资。对于含回售及赎回选择权的债券，本基金将利用债券市场收益率数据，运

用期权调整利差（OAS）模型分析含赎回或回售选择权的债券的投资价值，作为此类债券投资的主要依据。

4、中小企业私募债券投资策略 在控制信用风险的基础上，本基金对中小企业私募债券投资，主要通过期限和品

种的分散投资控制流动性风险。以买入持有到期为主要策略，审慎投资。

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

益。

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

风险、流动性风险等各种风险。

5、权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型，深入分析标的资产价格及其市场隐含波动率的变化，寻求其合理定价水平。

全面考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，谨慎投资，追求较稳定的当期收益。

6、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。

7、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。

八、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $60\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 40\% \times \text{中债总全价指数收益率}$

本基金选择中债总全价指数收益率作为债券投资部分的业绩比较基准。中债总全价指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场

等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），是中国目前最权威，

应用也最广的指数。中债总全价指数的构成品种基本覆盖了本基金的债券投资标

的，反映债券全市场的整体价格和投资回报情况。

本基金选择沪深 300 指数收益率作为股票投资部分的业绩比较基准。沪深 300 指

数样本覆盖了沪深市场 60%左右的市值，具有良好的市场代表性和可投资性。

若今后法律法规发生变化或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，依据维护投资者合法权益的原则，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并按照监管部门要求履行适当

程序后及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

九、基金的风险收益特征

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。

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投资组合报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人根据本基金合同规定，已复核了本投资组合报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 12 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 11,199,130.00 57.70

其中：股票 11,199,130.00 57.70

2 基金投资 --

3 固定收益投资 --

其中：债券 --

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 8,179,410.81 42.14

8 其他资产 31,425.39 0.16

9 合计 19,409,966.20 100.00

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 7,935,280.00 43.89

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 486,750.00 2.69

G 交通运输、仓储和邮政业 --

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 --

J 金融业 --

K 房地产业 1,041,900.00 5.76

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 838,200.00 4.64

O 居民服务、修理和其他服务业 --

P 教育 --

Q 卫生和社会工作 897,000.00 4.96

R 文化、体育和娱乐业 --

S 综合 --

合计 11,199,130.00 61.94

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	300367	东方网力	50,000	1,002,000.00	5.54
2	300015	爱尔眼科	30,000	897,000.00	4.96
3	600887	伊利股份	40,000	704,000.00	3.89
4	600535	天士力	15,000	622,350.00	3.44
5	002563	森马服饰	60,000	616,200.00	3.41
6	002481	双塔食品	60,000	544,200.00	3.01
7	600240	华业资本	50,000	537,000.00	2.97
8	002507	涪陵榨菜	40,000	535,200.00	2.96
9	600305	恒顺醋业	45,000	525,600.00	2.91
10	002570	贝因美	40,000	524,800.00	2.90

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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
本基金本报告期末未持有股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

11、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未发现存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 28,469.65

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 759.00

5 应收申购款 2,196.74

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 31,425.39

(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债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公

允价值(元)

占基金资产净

值比例 (%) 流通受限情况说明

1 300367 东方网力 1,002,000.00 5.54 重大事项

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、基金的净值表现

本期告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

2016.2.4-2016.6.30 6.56% 1.37% 4.31% 0.82% 2.25% 0.55%

2016.7.1-2016.9.30 -0.37% 0.74% 2.42% 0.49% -2.79% 0.25%

2016.10.1-2016.12.31 -8.33% 1.04% 0.03% 0.46% -8.36% 0.58%

注：本基金基金合同于2016年2月4日生效，建仓期为6个月，建仓期结束时

各项资产配置比例符合合同规定。

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

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事务所费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 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 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管

人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前五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、公休假等，支付日期顺延。

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 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管

人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中

一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

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,更新了“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)在“第八部分 基金的投资”中,更新了“基金的投资组合报告”的内容,截

止日期为2016年12月31日,该部分内容均按有关规定编制,并经本基金托管人复核,但

未经审计。

(六)更新“第九部分 基金的业绩”,该部分内容均按照有关规定编制,并经

本基

金托管人复核，但相关财务数据未经审计。

（七）在“第二十一部分 其他应披露事项”中，更新了自上次《招募说明书（更新）》截止日 2016 年 8 月 4 日到本次《招募说明书（更新）》截止日 2017 年 2 月 4 日之间的信息披露事项。

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

任公司网站 www.orient-fund.com。

东方基金管理有限责任公司

2017 年 3 月