

东方臻悦纯债债券型证券投资基金
招募说明书（更新）摘要
(2017 年度)

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

重要提示

东方臻悦纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据2016年9月5日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予东方臻悦纯债债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]2022号)准予募集注册。本基金基金合同于2017年5月25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《东方臻悦纯债债券型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

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

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

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

本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,理论上其长期平

均预期风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

本基金在投资中将国债期货纳入投资范围，因此，可能面临市场风险、基差风险、流动性风险等。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。本基金对固定收益类资产的投资中将资产支持证券纳入到投资范围当中，可能带来信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险以及法律风险。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资者的风险承受能力相适应。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2017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2017年11月25日。

一、基金合同生效日期

2017年5月25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：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	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，下设风险控制委员会、投资决策委员会、IT治理委员会、产品委员会和董事

会办公室、综合管理部、人力资源部、风险管理部、监察稽核部、财务部、信息技术部、电子商务部、运营部、交易部、权益投资部、研究部、固定收益部、专户投资部、量化投资部、市场部、机构业务一部、机构业务二部、产品开发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

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。

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。

2、监事会成员

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

杨晓燕女士,监事,硕士研究生,高级经济师。曾任职北京银行等金融机构,20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。

3、其他高级管理人员

崔伟先生,董事长,简历请参见董事介绍。

刘鸿鹏先生,总经理,简历请参见董事介绍。

秦熠群先生,副总经理,兼任东方汇智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
吴萍萍 (女士)	2017年5月25日起至今	中国人民大学应用经济学硕士, 6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、东方臻悦纯债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, 10年投资从业经历。曾任中国光大银行交易员, 中国民生银行中心总经理助理、高级交易员。2017年11月加盟东方基金管理有限责任公司。

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, 7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, 9年基金从业经历。历任工银瑞信基金管理有限公司产品开发部产品开发经理、安信基金管理有限责任公司市场部副总经理兼产品开发总监。2013年5月加盟东方基金管理有限责任公司, 曾任指数与量化投资部总经理、专户业务部

总经理、产品开发部总经理、投资经理、东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金(自 2015 年 12 月 3 日起转型为东方启明量化先锋混合型证券投资基金)基金经理。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。

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, 8 年证券从业经历。2009 年 12 月加盟东方基金管理有限责任公司, 曾任研究部金融行业、固定收益研究、食品饮料行业、建筑建材行业研究员, 东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方核心动力股票型开放式证券投资基金(于 2015 年 7 月 31 日更名为东方核心动力混合型证券投资基金)基金经理。现任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、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, 13 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, 现任东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方成长收益平衡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、东方新思路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、东方岳灵活配置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、东方稳健回报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

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司（简称：中国邮政储蓄银行）

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A座

法定代表人：李国华

成立时间：2007年3月6日

组织形式：股份有限公司

注册资本：810.31亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立机关及批准设立文号：中国银监会银监复〔2006〕484号

基金托管资格批文及文号：证监许可〔2009〕673号

联系人：王瑛

联系电话：010—68858126

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；办理票据承兑和贴现；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；提供保险箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会批准，中国邮政储蓄银行有限责任公司（成立于2007年3月6日）于2012年1月21日依法整体变更为中国邮政储蓄银行股份有限公司。中国邮政储蓄银行股份有限公司依法承继原中国邮政储蓄银行有限责任公司全部资产、负债、机构、业务和人员，依法承担和履行原中国邮政储蓄银行有限责任公司在有关具有法律效力的合同或协议中的权利、义务，以及相应的债权债务关系和法律责任。中国邮政储蓄银行股份有限公司坚持服务“三农”、服务中小企业、服务城乡居民的大型零售商业银行定位，发挥邮政

网络优势,强化内部控制,合规稳健经营,为广大城乡居民及企业提供优质金融服务,实现股东价值最大化,支持国民经济发展和社会进步。

(二) 主要人员情况

中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部,下设资产托管处、风险管理处、运营管理处等处室。现有员工 23 人,全部员工拥有大学本科以上学历及基金从业资格,90%员工具有三年以上基金从业经历,具备丰富的托管服务经验。

(三) 基金托管业务经营情况

2009 年 7 月 23 日,中国邮政储蓄银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会联合批准,获得证券投资基金托管资格,是我国第 16 家托管银行。2012 年 7 月 19 日,中国邮政储蓄银行经中国保险业监督管理委员会批准,获得保险资金托管资格。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心、以服务为基础的经营理念,依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、运作高效的业务处理模式,为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务,并获得了合作伙伴一致好评。

截至 2017 年 9 月 30 日,中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共 81 只。至今,中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品(本外币)、私募基金、证券公司资产管理计划、保险资金、保险资产管理计划等多种资产类型的托管产品体系,托管规模达 43172.64 亿元。

(四) 基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

作为基金托管人,中国邮政储蓄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

中国邮政储蓄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。托管业务部专门设置内部风险

控制处室, 配备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的工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

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员负责, 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。

(五) 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。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, 对违法违规行为及时予以风险提示, 要求其限期纠正, 同时报告中国证监会。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指标进行例行监控, 发现投资比例超标等异常情况, 向基金管理人发出书面通知, 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, 对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易, 电话或书面要求管理人进行解释或举证, 要求限期纠正, 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、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

2、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

3、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

4、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

5、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

6、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

7、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

8、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

9、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

10、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

11、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

12、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

13、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

14、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

15、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: 02223297867

客户服务电话: 022-83125066

网址: 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: 王骁骁

电话: 010-66295873

传真: 010-66578680

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

(四) 律师事务所和经办律师

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

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) 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：东方臻悦纯债债券型证券投资基金

(二) 本基金类型：债券型

(三) 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

本基金在严格控制风险并保持良好流动性的基础上，追求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，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债券、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、国债期货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。

本基金不参与权证、股票等权益类资产投资，可转债仅投资可分离交易可转

债的纯债部分。

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,其投资比例遵循届时有效的法律法规或相关规定。

基金的投资组合比例为:债券资产占基金资产的比例不低于 80%,本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 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

本基金根据宏观经济运行情况、货币政策走向、金融市场运行趋势和市场利率水平变化特点等进行分析研究,优选具有投资价值的个券,在严格控制风险并保持良好流动性的基础上,实现基金的持续稳定增值。

(一) 类属资产配置策略

鉴于各券种的收益率变化和利差变化的影响因素存在差异,且各经济阶段内的各券种波动性特征也存在不同,本基金通过综合分析、比较各券种的利差变化趋势、收益率水平、市场偏好、流动性等特征,结合具体宏观经济环境、政策环境的变化等因素,合理配置并动态调整类属债券的投资比例。

根据债券的发行主体、风险来源、收益率水平、市场流动性等因素,本基金将债券市场主要划分为一般债券(含国债、中央银行票据、政策性金融债等)和信用债券(含公司债、企业债、非政策性金融债、短期融资券、地方政府债等)两大类。

1、一般债券投资策略

国债、中央银行票据、政策性金融债等一般债券具有良好的流动性,本基金将通过对一般债券的投资为基金的流动性提供支持。

2、信用债券投资策略

信用债券的信用利差与债券发行人所在行业特征和自身情况密切相关。本基

金将通过行业分析、公司资产负债分析、公司现金流分析、公司运营管理分析和公司发展前景分析等细致的调查研究,分析信用债券的违约风险及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。

(二) 久期调整策略

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

(三) 期限结构策略

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

(四) 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。

(五) 国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时,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,通过对国债市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,利用金融

衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

(六) 其他金融工具的投资策略

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

八、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中债总全价指数收益率

本基金选择上述业绩比较基准的原因为本基金主要通过投资于债券等固定收益类资产获得收益,力争获取相对稳健的回报,追求基金资产的长期稳定增值。中债总全价指数由中央国债登记结算有限公司编制,该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况,具有广泛的市场代表性,符合本基金的投资目标。

若未来法律法规发生变化,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,或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在与基金托管人协商一致,履行适当程序后,适当调整业绩比较基准并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

九、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,理论上其长期平均预期风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。

十、基金投资组合报告

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 2017 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	840,319,000.00	61.95
	其中:债券	840,319,000.00	61.95
	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	500,059,447.35	36.86
8	其他资产	16,112,154.46	1.19
9	合计	1,356,490,601.81	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	49,880,000.00	5.06
	其中:政策性金融债	49,880,000.00	5.06
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	790,439,000.00	80.21
9	其他	-	-
10	合计	840,319,000.00	85.27

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	111709241	17 浦发银行 CD241	1,200,000	117,240,000.00	11.90
2	111705047	17 建设银行 CD047	1,000,000	97,840,000.00	9.93
3	111709259	17 浦发银行 CD259	700,000	68,425,000.00	6.94
4	111714172	17 江苏银行 CD172	600,000	58,602,000.00	5.95
5	111681045	16 杭州银行 CD192	600,000	57,864,000.00	5.87

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。

10、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的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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,112,154.46
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,112,154.46

(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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本期报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东方臻悦纯债债券 A

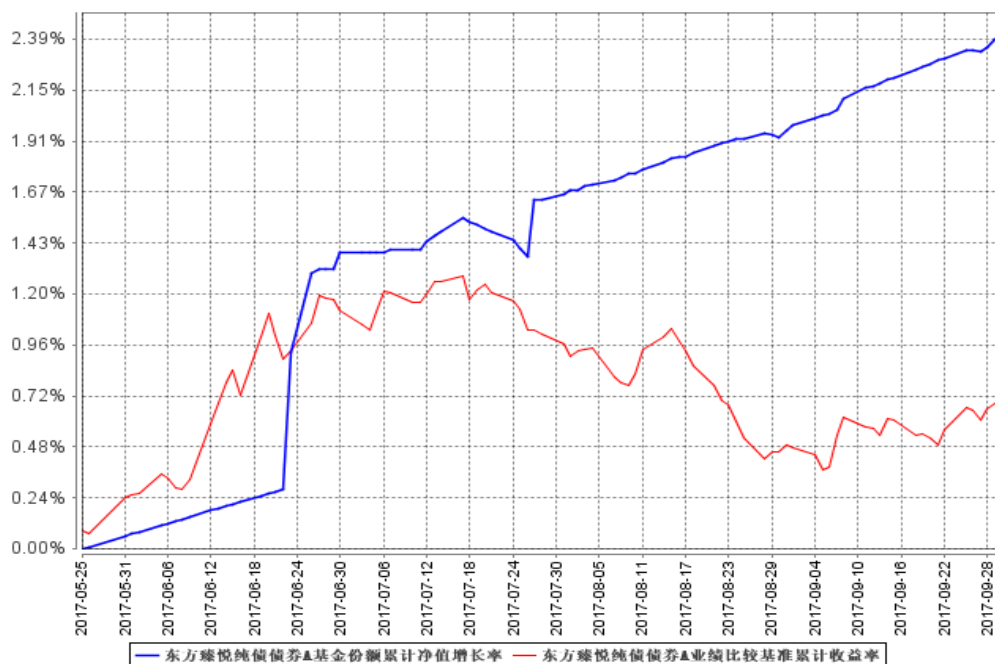
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017.5.25-2017.6.30	1.39%	0.14%	1.12%	0.10%	0.27%	0.04%
2017.7.1-2017.9.30	0.99%	0.04%	-0.42%	0.06%	1.41%	-0.02%

东方臻悦纯债债券 C

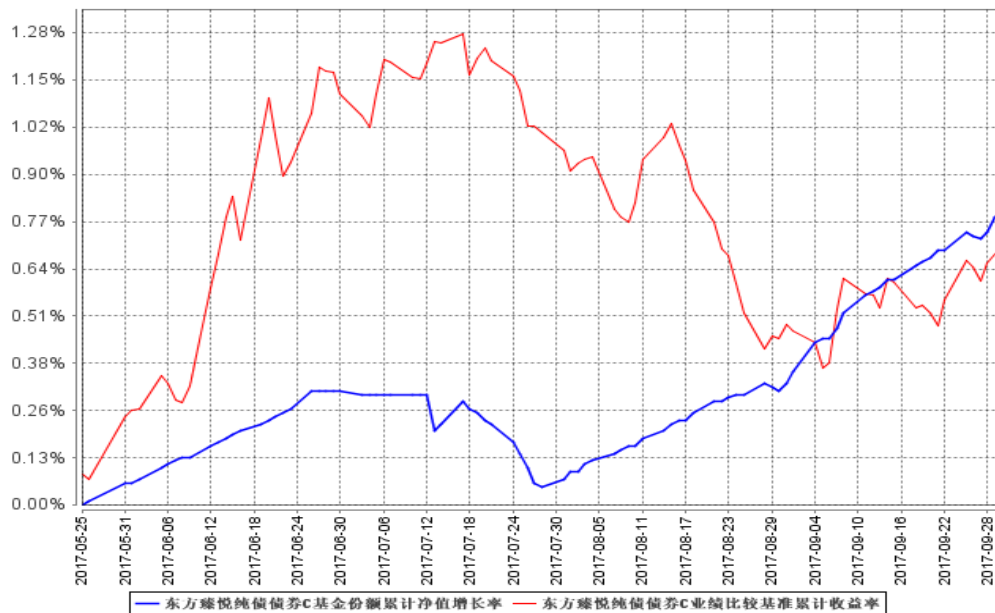
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017.5.25-2017.6.30	0.31%	0.01%	1.12%	0.10%	-0.81%	-0.09%
2017.7.1-2017.9.30	0.46%	0.03%	-0.42%	0.06%	0.88%	-0.03%

(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

东方臻悦纯债债券A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方臻悦纯债债券C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



注:本基金基金合同于2017年5月25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、诉讼费;
- 5、基金份额持有人大会费用;
- 6、基金的证券交易费用;
- 7、基金的银行汇划费用;
- 8、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。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

(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 0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提,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 5 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、公休日等,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 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提,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5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。

3、C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。

本基金销售服务费每日按前一日C类基金资产净值的0.40%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提,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销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性划出,由登记机构代收,登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

销售服务费主要用于本基金持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

(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。

十三、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定以及《东方臻悦纯债债券型证券投资基金基金合同》及

其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动进行了更新,主要内容如下:

(一)在“重要提示”中,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信息进行了更新。

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

(六)在“第八部分 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2017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。

(八)在“第二十一部分 其他应披露事项”中,增加了自基金合同生效日2017年5月25日到本次《招募说明书(更新)》截止日2017年11月25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

2018年1月