

东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金

招募说明书（更新）摘要

（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

东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1419号文和证监许可[2017]1557号文准予募集注册。本基金基金合同于2018年3月21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《东方量化成长灵活配置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有风险,等等。

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。

本基金采用量化模型构建股票投资组合,量化模型通过学习我国股票市场历史数据并总结其中的统计规律而产生,量化模型采用的历史数据的准确性、一致

性和连续性决定了量化模型的有效性和准确与否。因此，(1)由于量化模型采用的相关数据均来源于数据提供商或网络公开数据，在数据采集、预处理过程中可能发生因数据错误导致量化模型输出结果有偏差的风险；(2)当我国宏观经济环境、股票市场环境、交易规则等发生重大变化导致当前股票数据与历史数据存在重大差异时，本基金量化模型存在因无法获得一致性和连续性的数据而暂时失效，进而无法达到预期的投资效果的风险；(3)随着我国股票市场的发展，量化模型将遵循历史数据体现的统计规律不断发展和完善，在这个过程中，可能出现因对模型中某参数的调整影响模型有效性的风险。

本基金在投资中将股指期货、国债期货纳入到投资范围中，股指期货、国债期货均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、国债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。此外，本基金还可能面临市场风险、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；流动性风险既包括强制平仓风险也包括流通量风险，即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。

本基金在投资中将资产支持证券纳入到投资范围当中，可能带来以下风险：

①信用风险：基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

②利率风险：市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格的变动，一般而言，如果市场利率上升，本基金持有资产支持证券将面临价格下降、本金损失的风险，而如果市场利率下降，资产支持证券利息的再投资收益将面临下降的风险。

③流动性风险：受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。

④提前偿付风险：债务人可能会由于利率变化等原因进行提前偿付，从而使

基金资产面临再投资风险。

⑤操作风险：基金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、交易错误、IT系统故障等风险。

⑥法律风险：由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致基金财产的损失。

本基金可按照基金合同的约定投资流通受限证券。流通受限证券在一定的锁定期内不能卖出，可能面临无法及时变现的流动性风险、锁定期内市场价格波动风险等。

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2018年6月30日(财务数据未经审计)，本招募说明书其他所在内容截止日为2018年9月21日。

一、基金合同生效日期

2018年3月21日

二、基金管理人

(一) 基金管理人概况

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层

办公地址：北京市西城区锦什坊街28号1-4层

邮政编码：100033

法定代表人：崔伟

成立时间：2004年6月11日

组织形式：有限责任公司

注册资本：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

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、财富管理部二十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, 东证融汇证券资产管理有限公司董事。

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, 吉林省总会计师协会副会长, 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。

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. 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。

4. 本基金基金经理

| 姓名 | 任职时间 | 简历 |
|----|---------|----------------------|
| 盛泽 | 2018年8月 | 量化投资部总经理助理, 华威大学经济与国 |

| | | |
|-------------|-------------------------------|---|
| (先生) | 13日至今 | 际金融经济学硕士,3年投资从业经历。曾任德邦基金管理有限公司投资研究部研究员、基金经理助理职位。2018年7月加盟东方基金管理有限责任公司,现任东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金、东方启明量化先锋混合型证券投资基金、东方岳灵活配置混合型证券投资基金、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 刘志刚 (先生) | 2018年3月21日至2018年9月11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, 简历请参见董事介绍。

许文波先生, 公司总经理助理、权益投资总监、投资决策委员会委员。吉林大学工商管理硕士, 17年投资从业经历。曾任新华证券有限责任公司投资顾问部分析师; 东北证券股份有限公司资产管理分公司投资管理部投资经理、部门经理; 德邦基金管理有限公司基金经理、投资研究部总经理。2018年4月加盟东方基金管理有限责任公司, 现任东方精选混合型开放式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。

彭成军先生, 公司总经理助理, 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。曾任中国光大银行总行资金部衍生品模型分析师、外币债券投资经理、本外币衍生品投资经理; 中国民生银行金融市场部投资管理中心总经理助理、交易中心负责人, 负责固定收益及衍生品相关交易业务。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、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理。

蒋茜先生, 权益投资部总经理, 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。曾任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。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、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、东方利群混合型发起式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金。

王然女士, 研究部副总经理, 投资决策委员会委员, 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、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 现任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、东方民丰回报赢安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、东方大健康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。

6. 上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金托管人

(一) 基金托管人概况

1. 基本情况

名称: 中国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。

原玎,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”。

(四) 基金托管人的内部控制制度

1. 内部风险控制目标

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. 内部风险控制组织结构

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。

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。

(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。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。

2. 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。

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、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

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: 彭纯

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

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

客服电话: 95561

网址: www.cib.com.cn

4、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

5、长江证券股份有限公司

住所: 武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址: 武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人: 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

6、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

7、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

8、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

9、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

10、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

11、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

12、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

13、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

14、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

15、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

16、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

17、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: 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

18、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

19、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

20、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

21、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

22、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

23、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

24、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

25、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:刘宏莹

电话:010-60833754

传真:0755-83201097

客服电话:400-990-8826

网址:www.citicsf.com

26、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

27、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

28、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

29、包商银行股份有限公司

住所:内蒙古自治区包头市青山区钢铁大街6号

办公地址:内蒙古自治区包头市青山区钢铁大街6号

联系人:张建鑫

电话:010-64816038

传真:010-84596546

客户服务电话:95352

网址:www.bsb.com.cn

30、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

31、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 及 www.jjmmw.com

32、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

33、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

34、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

35、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

36、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

37、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

38、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

39、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

40、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

41、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

42、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

43、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

44、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

45、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

46、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

47、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

48、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

49、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

50、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

51、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

52、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

53、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

54、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

55、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

56、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

57、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

58、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

59、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

60、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

61、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

62、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

63、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

64、泰诚财富基金销售(大连)有限公司

住所: 辽宁省大连市沙河口区星海公园3号

办公地址: 辽宁省大连市沙河口区星海公园3号

联系人: 徐江

电话: 18840800358

客服电话: 400-0411-001

网址: www.haojiyoujijin.com

65、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

(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或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:俞卫锋

联系人:陆奇

电话:021-31358666

传真:021-31358600

经办律师:黎明、陆奇

(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

五、基金名称和基金类型

(一)本基金名称:东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金

(二)本基金类型:混合型基金

(三)基金运作方式:契约型、开放式

六、基金的投资目标和投资方向

(一)投资目标

运用量化投资策略持续挖掘具有良好成长性和收益特征的投资标的,力争获得超越业绩比较基准的投资回报。

(二)投资范围

本基金的投资范围主要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(包括国债、央行票据、金融债、政策性金融债、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、次级债券、可交换债券、可转换债券、分离交易的可转换债券等)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、

银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、权证、股指期货、国债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)。

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法律法规或相关规定。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为0%-95%;投资于权证的比例不超过基金资产净值的3%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)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%。

若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许,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调整。

七、基金的投资策略

(一) 类别资产配置策略

本基金结合我国宏观经济因素、市场估值因素、政策因素、证券市场行情因素等分析各类资产的市场趋势和收益风险水平,动态调整基金资产在权益类资产和固定收益类资产等大类资产间的配置比例,同时基于量化模型在权益类资产内部对不同风格的股票资产进行优化配置和动态调整。

(二) 股票投资策略

本基金通过量化技术对股票的成长性、收益性、流动性等方面进行评价,并利用量化选股模型筛选出具有良好成长性且收益预期优于我国A股市场整体表现的股票并构建投资组合。

1、选样空间

选股样本空间由同时满足以下条件的沪深A股组成:

- (1) 上市满一定时长;
- (2) 非ST、*ST股票,非暂停上市交易股票;
- (3) 根据一定规则剔除流动性相对差的股票。

2、量化多因子策略

(1) 多因子框架体系

本基金在量化研究中利用基金管理人研发的量化分析与投资平台 QuantPy, 在多因子选股模型构建过程中运用包括但不限于如下五类因子, 本基金对成长因子赋予相对较高的权重, 并在投资运作过程中不断优化和动态调整各类因子的权重:

- ①成长因子: 如 ROA、ROE、主营业务利润率、主营业务收入增长率等;
- ②价值因子: 如 PE、PB、市现率、市销率、自由现金流市值比率等;
- ③负债因子: 如资产负债率、现金流动负债比等;
- ④技术因子: 如反转因子、均线组合因子、动量因子等;
- ⑤人工智能因子: 如基于遗传算法的行业轮动因子, 基于机器学习的量化技术因子等。

(2) 选样方法

本基金动态利用多因子模型定期或不定期按以下方法在样本空间中选取一定数量的股票作为投资标的:

- ①计算样本空间中所有股票的各种因子值;
- ②对样本空间中每只股票的各种因子值按所对应权重加和, 得到综合因子值;
- ③对每只股票按因子值由大到小排序, 选取一定数量的股票。

(3) 股票权重计算

对选取的特定数量股票, 按综合因子值大小进行排序, 标准化处理后作为组合构建的权重数据。同时, 也可以根据策略的需要采取优化技术确定并动态调整股票的权重。

3、其他策略

本基金结合多因子模型, 以控制投资风险、降低基金回撤为目标, 适时采用行业轮动策略和量化择时策略等策略, 并可根据证券市场当期特点运用其他策略对多因子策略进行辅助, 以达到降低基金投资风险, 提高投资收益的目标。

(三) 债券投资策略

本基金通过对我国宏观环境、货币政策以及金融市场环境的分析, 结合各类券种的风险收益特征, 对类别券种进行动态配置, 并通过运用久期调整策略、期限结构策略等方法, 结合债券的流动性、信用风险分析, 对个券进行配置。

(四) 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。

(五) 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。

(六) 股指期货投资策略

本基金在严格控制投资风险的前提下,可参与股指期货的投资,进而提高投资效率。本基金进行股指期货的投资以套期保值为主要目的,本基金投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过对股票市场和股指期货市场短期和中长期趋势的研究,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,改善投资组合的风险收益水平。此外,本基金可运用股指期货对冲特殊情况下的流动性风险,以提升现金管理能力,如基金规模出现大幅波动,可通过股指期货进行仓位调整,以减少基金规模变动对基金投资运作带来的影响。

(七) 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。

八、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率×60%+中债总全价指数收益率×40%

本基金选择中证 500 指数收益率作为股票投资部分的业绩比较基准。中证 500 指数综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况。对沪深股市小盘股的整体走势具有较强的代表性。

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。

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,按照监管部门要求履行适当程序后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、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本投资组合报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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

本投资组合报告所载数据截止至 2018 年 6 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 | 311,667,991.00 | 53.20 |
| | 其中:股票 | 311,667,991.00 | 53.20 |
| 2 | 固定收益投资 | 38,671,500.00 | 6.60 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 3 | 其中：债券 | 38,671,500.00 | 6.60 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 170,000,000.00 | 29.02 |
| 6 | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| | 银行存款和结算备付金合计 | 53,369,758.95 | 9.11 |
| 7 | 其他各项资产 | 12,166,285.07 | 2.08 |
| 8 | 合计 | 585,875,535.02 | 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 | 3,745,602.00 | 0.65 |
| B | 采矿业 | 5,757,668.00 | 0.99 |
| C | 制造业 | 181,787,959.08 | 31.39 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,915,301.00 | 0.50 |
| E | 建筑业 | 4,445,992.60 | 0.77 |
| F | 批发和零售业 | 5,174,940.00 | 0.89 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 14,027,922.48 | 2.42 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 25,423,089.40 | 4.39 |
| J | 金融业 | 38,341,517.06 | 6.62 |
| K | 房地产业 | 7,687,656.00 | 1.33 |
| L | 租赁和商务服务业 | 6,642,122.40 | 1.15 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 135,534.00 | 0.02 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,398,122.60 | 0.24 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 11,328,010.38 | 1.96 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 2,805,104.00 | 0.48 |
| S | 综合 | 51,450.00 | 0.01 |
| | 合计 | 311,667,991.00 | 53.81 |

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 | 600519 | 贵州茅台 | 21,600 | 15,799,536.00 | 2.73 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 2 | 000858 | 五粮液 | 149,000 | 11,324,000.00 | 1.96 |
| 3 | 600009 | 上海机场 | 194,976 | 10,817,268.48 | 1.87 |
| 4 | 000651 | 格力电器 | 182,100 | 8,586,015.00 | 1.48 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 132,757 | 7,776,905.06 | 1.34 |
| 6 | 300059 | 东方财富 | 576,620 | 7,599,851.60 | 1.31 |
| 7 | 300015 | 爱尔眼科 | 222,822 | 7,194,922.38 | 1.24 |
| 8 | 002008 | 大族激光 | 134,900 | 7,175,331.00 | 1.24 |
| 9 | 600585 | 海螺水泥 | 205,100 | 6,866,748.00 | 1.19 |
| 10 | 603288 | 海天味业 | 92,905 | 6,841,524.20 | 1.18 |

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 | 30,114,000.00 | 5.20 |
| | 其中:政策性金融债 | 30,114,000.00 | 5.20 |
| 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) | 8,557,500.00 | 1.48 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 38,671,500.00 | 6.68 |

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 | 018005 | 国开1701 | 300,000 | 30,114,000.00 | 5.20 |
| 2 | 110038 | 济川转债 | 70,000 | 8,557,500.00 | 1.48 |
| 3 | - | - | - | - | - |
| 4 | - | - | - | - | - |
| 5 | - | - | - | - | - |

6、报告期末按公允价值占基金资产净值利弊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) 本基金所持有格力电器(000651.SZ)于2017年7月26日公告:公司近日收到中国证券监督管理委员会广东监管局(以下简称“广东证监局”)对公司董事徐自发先生下达的行政监管措施决定书《关于对徐自发采取出具警示函措施的决定》((2017)39号,以下简称“《决定书》”),《决定书》的主要内容为:“徐自发,经查,你于2015年6月起至今任格力电器董事。2016年11月24日,你通过交易所集中竞价交易的方式买入格力电器股票575,300股,成交均价为26.39元/股,成交金额1518.22万元。2017年5月22日,你再次通过交易所集中竞价交易的方式,卖出格力电器股票400,825股,成交均价为33.45元/股,成交金额1340.76万元。你作为格力电器的董事,将持有的格力电器股票在买入后不足6个月卖出,违反了《证券法》第四十七条的规定,现对你采取出具警示函的监管措施。你应该认真吸取教训,加强证券法律法规学习,严格规范买卖上市公司股票行为,采取切实有效措施杜绝此类违规行为再次发生。”公司同时给出相关说明:“徐自发先生于2017年5月22日通过深圳证券交易所集中竞价交易系统减持了本公司部分股份。减持过程中,因其委托某券商营业部客户经理对短线交易相关法律法规理解偏差,出现本次短线交易。公司已于2017年5月27日对相关情况进行了公告(公告编号:2017-020),徐自发先生因本次短线交易产生的收益2,829,824.5元已经收归公司所有。”

格力电器于2017年10月19日公告:公司董事徐自发先生于2017年10月18日收到中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《调查通知书》(编号:粤证调查通字170202号),该通知书内容为“因涉嫌违反证券法律法规,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,我会决定对你立案调查,请予以配合。”

以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。

本基金所持有的爱尔眼科(300015)于2018年4月21日公告,公司涉及一项股权转让协议纠纷,案件内容为:“公司起诉余某、肖某违反双方签署的《股权转让协议》约定的相关义务,给我方造成损失。要求两被告共同赔偿损失并支付违约金1990万元。”目前一审已判决。

以上事项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: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。在全面深入研究的基础上,提出大类资产配置建议、目标久期建议、类属资产配置建议等。

②资产配置决策:投资决策委员会依据上述研究报告,对基金的资产配置比例、目标久期设定等提出指导性意见。基金经理基于投研部门的投资建议,根据自己对未来一段时期内宏观经济走势的基本判断,对基金资产的投资,制定月度资产配置和久期设置计划,并报投资决策委员会审批,审批通过,方可按计划执行。

③组合构建:大类资产配置比例范围及目标久期设定范围确定后,基金经理参考研究员的投资建议,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。

④交易执行:交易管理部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。

⑤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。

⑥风险绩效评估:风险管理部定期和不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。基金经理可以据此检讨投资策略,进而调整和优化投资组合。

⑦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,结合基金申购和赎回的现金流量情况,对投资组合进行动态调整,使之不断得到优化。

本基金投资格力电器主要基于以下原因:

珠海格力电器股份有限公司是目前全球最大的集研发、生产、销售、服务于
一体的国有控股专业化空调企业。公司是唯一成为“世界名牌”的中国空调业品
牌,公司产品产销量连续多年全球领先。2005年至今,格力家用空调产销量连续
13年领跑全球,2006年荣获“世界名牌”称号。

格力电器作为空调行业龙头,2017年全年,公司实现营业收入1482.86亿元,
同比增长36.92%;归母净利润224.01亿元,同比增长44.87%。其中,第四季度
营业收入374.12亿元,同比增长44.59%;归母净利润69.4亿元,同比增长
63.91%。2018年一季度延续良好表现,实现营业收入395.6亿元,同比增长
33.29%;归母净利润5.58亿元,同比增长39.04%。

公司业绩长期稳定增长,具有较高的营收成长性。估值方面,公司上市以来
平均估值18.34倍,近10年平均估值11.99倍,近3年平均估值仅为11.16倍,
明显被低估,有充足回升空间。综合看来,具有较高投资价值。

本基金投资爱尔眼科主要基于以下原因:

爱尔眼科是第一家IPO上市的眼科医疗服务企业,借力于行业和模式的优势,
现已成长为眼科医疗服务龙头企业。上市九年,爱尔眼科由2009年底市值
65.15亿元增长至目前的770亿元(截至2018年二季度),增长11倍。上市至
2017年营收增长近10倍,净利润增长近9倍,CAGR均大于30.00%。

公司加快完善全国分级连锁网络,通过上市公司和并购基金双轮驱动扩张,
规模效应逐渐显现,公司国际化战略持续推进。近年来公司实现了快速增长,同
时财务指标优异,因此具备一定的长期投资价值。

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) 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 58,708.56 |
| 2 | 应收证券清算款 | 11,595,704.60 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 499,661.25 |

| | | |
|---|-------|---------------|
| 5 | 应收申购款 | 12,210.66 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 12,166,285.07 |

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 110038 | 济川转债 | 8,557,500.00 | 1.48 |

(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。

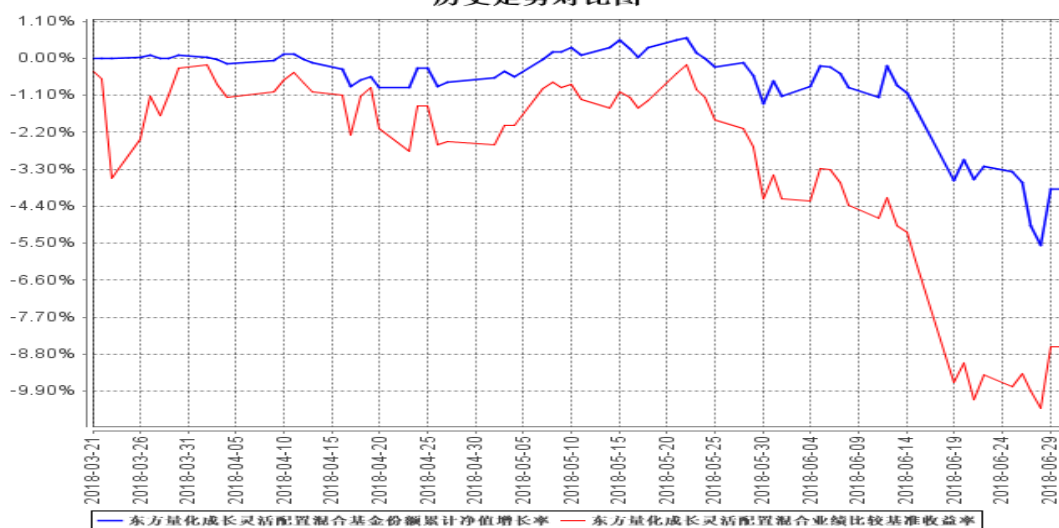
(一) 基金净值表现

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

| 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 |
|-----------------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 2018.03.21-2018.06.30 | -3.88% | 0.49% | -8.57% | 0.89% | 4.69% | -0.40% |

(二) 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

东方量化成长灵活配置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



注:本基金基金合同于2018年3月21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) 管理费率:

本基金的管理费每日按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。

(二) 托管费率:

本基金的托管费每日按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。

十三、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关规定以及《东方量化成长灵活配置混合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“第五部分 相关服务机构”中,更新了相关服务机构的信息。

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

(五)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2018年6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。

(六)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。

(七)在“第十六部分 风险揭示”中，增加了资金前端额度控制的相关风险提示

(八)在“第二十一部分 其他应披露事项”中，增加了从基金合同生效日2018年3月21日到本次《招募说明书(更新)》截止日2018年9月21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11月