

**东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金
招募说明书（更新）摘要
（2020年第1号）**

基金管理人：东兴证券股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

二零二零年六月

重要提示

东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2019年10月11日经中国证券监督管理委员会证监许可【2019】1900号文注册募集。本基金基金合同于2020年4月15日正式生效。

基金管理人保证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投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因证券市场波动等因素产生波动，本基金在投资运作过程中可能面临各种风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等，详见招募说明书“风险揭示”章节。

本基金为采用摊余成本法的定期开放债券型基金，属证券投资基金中的较低风险收益品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。采用摊余成本法估值不等同于保本，基金资产发生计提减值准备可能导致基金份额净值下跌。基金严格采用买入并持有到期策略可能损失一定的债券交易收益。

投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本招募说明书约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：东兴证券股份有限公司

成立日期：2008年5月28日

注册地址：北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）12、15层

办公地址：北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）6、10、12、15、16层

法定代表人：魏庆华

组织形式：股份有限公司

联系人：陈智勇

联系电话：010-57307309

传真：010-57307388

注册资本：275796.0657万元人民币

股权结构：（截止2020年3月末）

序号	股东名称	持股数量（股）	持股比例（%）
1	中国东方资产管理股份有限公司	1,454,600,484	52.74
2	山东高速股份有限公司	119,989,367	4.35
3	中国证券金融股份有限公司	82,463,160	2.99
4	福建天宝矿业集团股份有限公司	57,478,000	2.08
5	上海工业投资（集团）有限公司	48,100,000	1.74

（二）主要人员情况

1、董事会成员

魏庆华先生，1964年10月出生，博士研究生学历，高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于福建清流县外贸局。曾任清流县人民银行股长、副行长；三明市人民银行办公室副主任（主持工作）；闽发证券三明分公司总经理、闽发证券副总裁、总裁，东兴证券副总经理、总经理、财务负责人，东兴期货董事长，东兴资本董事长，东兴投资董事长。现任东兴证券董事长。

张涛先生，1972年8月出生，博士研究生学历，正高级经济师，中国国籍，

无境外永久居留权。曾任华泰证券总裁办公室总裁秘书、投资银行一部业务经理、福州办事处副主任、上海总部投资银行业务部副总经理（主持）、深圳总部副总经理（主持）兼深圳彩田路营业部总经理、董事会秘书兼总裁助理、董事会办公室主任、副总裁，华泰期货有限公司董事长，钟山有限公司董事、副总裁，钟山金融控股有限公司董事长。现任东兴证券董事、总经理、财务负责人，东兴证券投资有限公司董事长。。

谭世豪先生，1964年1月出生，硕士研究生，高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国银行国际业务部科员、主任科员、副处长、处长；中国东方资产管理股份有限公司（以下简称“中国东方”）股权及投行部经理、助理总经理，资产经营部助理总经理、副总经理；深圳外贸集团董事长，监事长；邦信资产管理有限公司副总经理兼深圳分公司副总经理；中国东方人力资源部副总经理；东兴证券副董事长。现任东兴证券董事、副总经理，东兴证券（香港）金融控股有限公司董事会主席。

张军先生，1975年5月出生，硕士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任北京市园林局香山公园科员；中诚信托投资有限责任公司信托经理；证监会发行监管部审核一处科员、副调研员、副处长；东兴证券首席风险官。现任东兴证券董事、副总经理，东兴香港董事。

江月明先生，1971年8月出生，硕士研究生学历，持有中国律师执业资格证书，中国国籍，无境外永久居留权。2001年7月至2016年8月历任中国东方经营处置审查办公室职员、高级主任，总裁办公室经理、高级经理、助理总经理，风险管理部助理总经理、副总经理，董事会办公室（引战上市办公室）副总经理（主持工作）。现任中国东方董事会办公室（上市办公室）总经理，东富（天津）股权投资基金管理有限公司董事，东方邦信创业投资有限公司董事。2017年3月至今任东兴证券董事。。

曾涛先生，1972年12月出生。大学本科学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于中国银行股份有限公司海南省分行，中国东方海口办事处。曾任中国东方人力资源部高级经理、总经理助理、副总经理，机构管理部副总经理主持工作，中华联合保险集团股份有限公司副总经理、合规负责人、纪委书记。现任中国东方办公室（党委办公室）总经理，大连银行股份有限公司董事。2019年3

月起任东兴证券董事。

董裕平先生，1969年10月出生，博士研究生学历，研究员（中国社科院）、博士生导师、博士后合作导师，哈佛大学经济系访问学者，中国国籍，无境外永久居留权。曾任国家开发银行政策研究室科级行员、经济师，稽核评价局稽核一处副处长、综合处副处长、正处级行员、高级经济师；中国社会科学院金融研究所副研究员、研究员、公司金融研究室主任、法与金融研究室主任、所纪委委员、所长助理，兼任中国社会科学院投融资研究中心主任；中国东方战略发展规划部副总经理、战略发展规划部（研究院）副总经理（主持工作）。现任中国东方战略发展规划部（研究院）总经理，东方邦信融通控股股份有限公司董事。2019年3月起任东兴证券董事。

周亮先生，1971年6月出生，大学本科学历，高级会计师，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职济青高速公路管理局、山东高速光控产业基金管理有限公司、山东高速股份有限公司。历任山东高速股份有限公司淄博管理处计划财务科长、计划财务部副经理、审计部经理，山东高速光控产业基金管理有限公司财务总监，山东高速股份有限公司副总会计师、计划财务部经理。现任山东高速股份有限公司总会计师。2019年10月任东兴证券股份有限公司董事。

郑振龙先生，1966年3月出生，博士研究生学历，厦门大学管理学院教授，中国国籍，无境外永久居留权。曾任厦门大学研究生院副院长、经济学院副院长、金融系副主任（主持工作），华福证券股份有限公司独立董事。现任厦门大学闽江学者特聘教授，兼任华安证券股份有限公司独立董事，厦门国际银行股份有限公司独立董事、福建华通银行股份有限公司独立董事、营口港务股份有限公司独立董事和漳州片仔癀药业股份有限公司独立董事。2017年3月至今任东兴证券独立董事。

张伟先生，1977年4月出生，博士研究生，具有FRM（金融风险管理师）资格，中国国籍，无境外永久居留权。2001年8月至2012年2月，历任中国人民银行研究生部教研部研究实习员、副主任兼助理研究员；中国人民银行研究生部行政部副主任兼副研究员。2012年3月至今任清华大学五道口金融学院校友办主任兼副研究员。主要从事宏观经济、货币政策、汇率体制、股票投资、外汇投资、金融稳定机制、金融危机预警机制等方面研究。2017年3月起任东兴证券

独立董事。

宫肃康先生，1965年3月出生，硕士研究生学历，注册会计师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中央财政金融学院税务系教师，北京市新技术产业开发试验区财政审计所专管员，宁波创源文化发展股份有限公司独立董事。现任北京天平会计师事务所有限责任公司执行董事总经理，北京天平健税务师事务所执行董事、总经理。2017年12月至今任东兴证券独立董事。

孙广亮先生，1963年7月出生，硕士研究生学历，律师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国法律事务中心律师，众鑫律师事务所律师，大商股份有限公司独立董事。现任北京市华堂律师事务所合伙人律师、主任，大恒新纪元科技股份有限公司独立董事。2017年12月至今任东兴证券独立董事。

2、监事会成员

秦斌先生，1968年4月出生，博士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国银行总行海外行管理部科员、主任科员；中国东方股权部业务三部助理经理、股权及投行业务部副经理、市场开发部业务发展部副经理、总裁办公室综合信息处副经理（主持工作）、总裁办公室助理总经理、党委办公室和总裁办公室副主任、副总经理、党委办公室和研发中心副主任、副总经理（主持工作）、研发中心总经理、战略发展规划部总经理；东兴证券董事。现任东兴证券监事会主席。

张威先生，1977年9月出生，博士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任国务院法制办公室副主任科员、主任科员、副处长、调研员兼副处长（主持工作）。现任中国诚通控股集团有限公司金融管理部总经理、诚通基金管理有限公司董事、南航国际融资租赁有限公司副董事长、诚通商业保理有限公司董事长、中企大象金融信息服务有限公司监事长。2020年6月至今任东兴证券监事。

叶淑玉女士，1957年5月出生，物理学学士、中欧EMBA，高级工程师、会计师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任福州无线电七厂质检科副科长兼厂团总支书记；福州电子工业局团委委员；福州智达电脑品管部副经理；福建新世纪电脑集团有限公司副总裁；实达电脑集团人力资源处处长、监事；实达电脑与美国Compaq合资公司副总经理；上海外高桥房地产有限公司副总经理。现任福建

东煌投资集团股份有限公司董事、董事长助理兼董事会秘书，福建天宝矿业集团股份有限公司董事、副总裁兼董事会秘书。2017年3月至今任东兴证券监事。

郝洁女士，1971年4月出生，硕士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾在中国信达信托投资公司证券部财务处、信达资产管理公司资金财务部会计制度处工作，历任宏源证券机构管理总部二级部经理、资金财务部总经理助理、财务会计部副总经理；现任东兴证券财务部总经理，兼任东兴投资董事、东兴期货董事、东兴香港董事。2017年3月至今任东兴证券监事会职工代表监事。。

杜彬先生，1973年2月出生，大学本科学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国人民银行条法司综合处科员；中国民族国际信托投资公司计划资金部职员、总裁秘书，国际业务部副经理、资产管理部总经理、综合管理部总经理，民族证券风险监控部法务负责人、合规部经理，合规部副总经理（主持）、总经理，合规部兼风险管理部总经理，合规风控部总经理；现任东兴证券合规法律部总经理、东兴投资董事、东兴期货监事、东兴资本监事、上海东策盛资产管理有限公司监事。2014年8月至今任东兴证券监事会职工代表监事。。

3、总经理及其他高级管理人员

魏庆华、张涛先生、谭世豪和张军先生，简历请参见上述关于董事的介绍

许学礼先生，1963年12月出生，博士研究生学历，高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任财政部财政科学研究所助理研究员；中国南山开发公司上市小组成员；深圳证券交易所高级研究员；广州尊荣集团副总经理；深圳汉君雄投资公司副总经理；亚洲控股有限公司总裁助理；大通证券股份有限公司副总经理；东兴证券首席风险官，东兴资本董事。现任东兴证券副总经理、合规总监、首席风险官，东兴香港董事、东兴基金管理有限公司董事。

银国宏先生，1974年3月出生，博士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国教育科技信托投资公司证券营业部研究咨询部经理；中信建投证券研究所所长助理；东兴证券研究所总经理，公司助理总经理兼研究所总经理、机构业务部总经理、资产管理业务总部总经理、基金业务部总经理。现任东兴证券副总经理、金融创新部总经理，东兴期货董事长，上海伴兴实业发展有限公司董事长，东兴基金董事长。

刘亮先生，1974年10月出生，大学本科学历，中国国籍，无境外永久居留

权。曾就职于福建省政府办公厅证券办、中国证监会福建特派员办事处。曾任福建省证券监督管理委员会科员，中国证监会福建监管局科员、副主任科员、主任科员、党办副主任、稽查处副处长、纪委委员、党办副主任（主持）、党办主任；东兴证券助理总经理、总经理办公室总经理、场外市场业务总部总经理、新疆分公司总经理、深圳分公司总经理、东兴证券董事会秘书，董事会办公室总经理、福建分公司总经理。现任东兴证券副总经理、首席信息官，兼任天翼电子商务有限公司董事。

陈海先生，1970年12月出生，大学本科学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任闽发证券深圳营业部会计主管、福州五一中路营业部分析师、信息研究中心股评部经理、福州北环东路营业部助理总经理；东兴证券福州北环东路营业部助理总经理、副总经理、营销总监，福州五一中路营业部江厝服务部负责人、福州江厝营业部总经理、福建分公司副总经理，公司助理总经理兼任资产管理业务总部业务一部总经理、公司助理总经理兼任资产管理业务总部总经理。现任东兴证券副总经理，东兴香港董事，东兴证券（香港）有限公司董事会主席。

张锋先生，1973年12月出生，硕士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国银行总行营业部出口处职员；中国东方股权部、实业部、评估部助理经理、副经理；东兴证券北京北四环中路证券营业部总经理、企业融资部总经理、财富管理部总经理、协同发展部总经理。现任东兴证券董事会秘书、公司助理总经理。

赵慧文女士，1977年1月出生，硕士研究生学历、注册会计师、资产评估师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国证监会稽查一局主任科员、中国证监会稽查局综合处副处长和处长、中国证监会发行监管部审核五处处长、中国证监会证券基金机构监管部监管六处处长、中原证券股份有限公司副总裁。现任东兴证券首席风险官。

4、合规总监

许学礼先生，简历请参见上述关于总经理及其他高级管理人员的介绍。

5、本基金基金经理

张琳娜，对外经济贸易大学金融学硕士，从业经验11年。曾任益民基金管理有限公司集中交易部副总经理，英大基金固定收益部总经理。曾管理的英大纯

债基金取得 2016 年上海证券报主办第 14 届“金基金”奖，同时获得证券时报第 13 届中国基金业明星基金奖三年持续回报普通债券型明星基金（2015-2017）。现任东兴兴利债券型证券投资基金、东兴安盈宝货币市场基金、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

6、基金业务投资决策委员会成员

银国宏先生，简历请参见上述关于经营管理层人员的介绍

王青女士，现任基金业务部总经理。

张旭先生，现任基金业务部助理总经理、投资总监。

孙继青先生，现任基金业务部基金经理。

张琳娜女士，现任基金业务部基金经理。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：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

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755-83199084

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并

于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2019年12月31日，本集团总资产74,172.40亿元人民币，高级法下资本充足率15.54%，权重法下资本充足率13.02%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、养老金团队、系统与数据团队7个职能团队，现有员工86人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，推出国内首个托管大数据平台，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺2016年中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”。2017年6月招商银行再度荣膺《财资》

“中国最佳托管银行奖”；“全功能网上托管银行 2.0”荣获《银行家》2017 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018 年 1 月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2017 年度优秀资产托管机构”奖项；同月，招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获 2016-2017 年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3 月荣膺公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；5 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12 月荣膺 2018 东方财富风云榜“2018 年度最佳托管银行”、“20 年最值得信赖托管银行”奖。2019 年 3 月招商银行荣获《中国基金报》“2018 年度最佳基金托管银行”奖；6 月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳零售基金行政外包”三项大奖；12 月荣获 2019 东方财富风云榜“2019 年度最佳托管银行”奖。

（二）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014 年 7 月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013 年 5 月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

汪建中先生，本行副行长。1991 年加入本行；2002 年 10 月至 2013 年 12 月历任本行长沙分行行长，总行公司银行部副总经理，佛山分行筹备组组长，佛山分行行长，武汉分行行长；2013 年 12 月至 2016 年 10 月任本行业务总监兼公司金融总部总裁，期间先后兼任公司金融综合管理部总经理、战略客户部总经理；2016 年 10 月至 2017 年 4 月任本行业务总监兼北京分行行长；2017 年 4 月起任

本行党委委员兼北京分行行长。2019年4月起任本行副行长。

（三）基金托管业务经营情况

截至2019年12月31日，招商银行股份有限公司累计托管545只证券投资基金。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）东兴证券股份有限公司直销中心

a、东兴证券股份有限公司网上直销系统

交易系统网址：<https://tradefund.dxzq.net/etrading/>

b、东兴证券股份有限公司直销柜台

办公地址：北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层

联系人：陈智勇

直销中心电话：010-57307309

传真：010-57307388

公司网站：<http://www.dxzq.net>

（2）东兴证券股份有限公司分支机构

住所：北京西城区金融大街5号新盛大厦B座6层

办公地址：北京西城区金融大街5号新盛大厦B座6层

法人代表：魏庆华

联系人：田丰舞

传真：010-57307388

2、代销机构

基金销售机构的具体名单见基金份额发售公告，基金管理人可根据有关法律法规、依据实际情况增减、变更基金销售机构。各销售机构的具体名单见基金管理人届时发布的增减或变更销售机构的相关公告。

（二）登记机构

名称：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

法定代表人：魏庆华

办公地址：北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层

联系人：王广辉

电话：010-57307359

传真：010-57307366

（三）律师事务所

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层

办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层

负责人：朱小辉

电话：010-57763888

传真：010-57763777

经办律师：吴冠雄、李晗

（四）会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市黄浦区延安东路222号外滩中心30楼

办公地址：北京市朝阳区针织路23号中国人寿金融中心10层

执行事务合伙人：曾顺福

联系电话：021-61418888

传真：010-85181218

经办注册会计师：李燕、邱丽

四、基金名称和基金类型

（一）本基金名称：东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金

（二）本基金类型、运作方式及存续期：

本基金类型：债券型证券投资基金

本基金运作方式：契约型，定期开放式

本基金存续期：不定期

五、基金的投资目标和投资方向

（一）投资目标

本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的稳健增值。

（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债券（包括国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场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）。

本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

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：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%。但为开放期流动性需要，保护基金份额持有人利益，在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内，本基金所持有现金及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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；在封闭期内，本基金不受该比例的限制。

六、基金的投资策略

（一）封闭期投资策略

本基金以封闭期为周期进行投资运作。为力争基金资产在开放前可完全变现，本基金在封闭期内采用买入并持有到期投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资资产到期日（或回售日）不得晚于封闭运作期到期

日。本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭运作期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。

在基金运作中，基金管理人可以基于持有人利益优先原则，在不违反《企业会计准则》的前提下，对尚未到期的固定收益类品种进行处置。

1、资产配置策略

每个封闭期初，本基金首先对回购利率与短债收益率、协议存款利率进行比较，并在对封闭期资金面进行判断的基础上，判断是否存在利差套利空间，以确定是否进行杠杆操作；其次对各类金融工具在封闭期内的持有期收益进行比较，确定优先配置的资产类别，并结合各类金融工具的市场容量，确定配置比例。

2、银行定期存款、协议存款及大额存单投资策略

封闭期初，本基金在向交易对手银行进行询价的基础上，选取利率报价较高的几家银行进行协议存款投资，注重分散投资，降低交易对手风险。

3、信用债投资策略

本基金由于采用买入并持有策略，在债券投资上主要持有剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的债券品种。信用债市场整体的信用利差水平和信用债发行主体自身信用状况的变化都会对信用债个券的利差水平产生重要影响，本基金将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势；并通过信用研究和评级制度，研究债券发行主体企业的基本面，以确定企业主体债的实际信用状况。

4、杠杆投资策略

本基金将在考虑债券投资的风险收益情况，以及回购成本等因素的情况下，在风险可控以及法律法规允许的范围内，通过债券回购，进行杠杆操作。

本基金将在封闭期内进行杠杆投资，杠杆放大部分投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，并采取买入并持有到期的策略。同时采取滚动回购的方式来维持杠杆，因此负债的资金成本存在一定的波动性。一旦建仓完毕，初始杠杆确定，将维持基本恒定。通过这种方法，本基金可以将杠杆比例稳定控制在一个合理的水平。

5、再投资策略

由于在建仓期本基金的投资难以做到与封闭期剩余期限完美匹配，因此可能存在持有的部分投资品种在封闭期结束前到期兑付本息的情形。另一方面，本基金持有的部分投资品种的付息也将增加基金的现金头寸。对于现金头寸，本基金将根据届时的市场环境和封闭期剩余期限，选择到期日（或回售日）在封闭期结束之前的债券、回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等进行投资，并采用买入持有到期投资策略。

6、资产支持证券投资策略

包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等在内的资产支持证券，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述基本面因素，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。

（二）开放期投资策略

开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。

今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

七、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日的中国人民银行公布并执行的金融机构三年期定期存款利率（税后）+0.25%。

本基金以每个封闭期为周期进行投资运作，每个封闭期为三年。以与封闭期同期对应的金融机构三年期定期存款利率（税后）+0.25%作为本基金的业绩比较基准符合产品特性，能够使本基金投资人理性判断本基金产品的风险收益特征和流动性特征，合理衡量本基金的业绩表现。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，经与基金托管人协商一致，本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开

基金份额持有人大会。

八、 风险收益特征

本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

九、 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、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的证券账户开户费用、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。

（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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基

金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前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、公休假或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类中第3—9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。

暂停运作期间的相关费用，由基金管理人承担。暂停运作期间，基金不收取管理费、托管费。

（三）不列入基金费用的项目

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纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

十、其他应披露事项

本基金的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的内容与格式进行披露，并在指定媒介上公告。本招募说明书将按中国证监会有关规定定期进行更新。招募说明书解释与基金合同不一致时，以基金合同为准。

从上次《招募说明书》披露日 2019 年 12 月 28 日到本次《招募说明书（更新）》内容截止日 2020 年 6 月 10 日之间的信息披露事项：

- 1、关于东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金延期结束募集的公告
2020-03-14
- 2、关于暂停公募基金网站和网上交易服务的公告 2020-04-03
- 3、东兴证券股份有限公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司代销旗下基金业务的公告 2020-05-07
- 4、东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金降低管理费率、托管费率的公告 2020-6-10

十一、对招募说明书更新部分的说明

鉴于本基金自2020年6月10日起降低管理费率、托管费率，本基金管理人依据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关法律法规的要求，对本基金原招募说明书中有关费用的内容进行了更新，并对包括但不限于基金管理人、基金托管人、相关服务机构等其他信息一并进行了更新。

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，可登录东兴证券股份有限公司网站 <http://www.dxzq.net>。

东兴证券证券股份有限公司
2020年6月12日