

东方盛世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 2 号）

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

## 重要提示

东方盛世灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据2015年7月21日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予东方盛世灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]1745号)和2016年3月31日中国证监会证券投资基金机构监管部《关于东方盛世灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》(机构部函[2016]671号)进行募集。本基金基金合同于2016年4月15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《东方盛世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《东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括:证券市场整体环境引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,大量赎回或暴跌导致的流动性风险,基金投资过程中产生的操作风险,因交收违约和投资债券引发的信用风险,基金投资对象与投资策略引致的特有风险,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。

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

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。

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。

本基金自2016年6月3日至2016年6月29日以通讯方式召集基金份额持有人大会,会议审议了《关于调整东方盛世灵活配置混合型证券投资基金管理费并修改基金合同的议案》,本基金于2016年6月30日计票通过上述议案,并自2016年6月30日起施行新的管理费率。关于本次基金份额持有人大会的召集情况及表决结果,详情可参见本基金管理人网站披露的相关公告。

根据中国证监会2017年10月1日起施行的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求,经与相关基金托管人协商一致,并报监管部门备案后,本基金管理人对旗下部分基金的基金合同及托管协议进行了修订,修订后的基金合同及托管协议自2018年3月31日起生效,具体情况请参阅本基金管理人于2018年3月31日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及本基金管理人网站上发布的公告。

有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30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2018年10月15日。

## 一、基金合同生效日期

2016年4月15日

## 二、基金管理人

### (一) 基金管理人基本情况

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

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、权益研究部、固定收益投资部、固定收益研究部、量化投资部、产品

开发部、专户投资部、机构业务一部、战略客户部、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、财富管理部二十一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第一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	任职日期	简历
王然	2016-4-15	权益研究部副总经理,投资决策委员会委员,北京

<p>(女士)</p>	<p>至今</p>	<p>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、东方合家保本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、东方大健康混合型证券投资基金基金经理。</p>
<p>周薇 (女士)</p>	<p>2016-4-15至今</p>	<p>中国人民银行研究生部金融学博士, 9年证券从业经历, 曾任中国银行总行外汇期权投资经理。2012年7月加盟东方基金管理有限责任公司, 曾任固定收益部</p>



		<p>债券研究员、投资经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场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(于2017年8月23日起转型为东方永润债券型证券投资基金)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、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理。现任东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方永润债券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、东方稳定增利债券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、东方永熙18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	---

#### 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、量化投资部总经理，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、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、固定收益研究部总经理，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。曾任中国光大银行交易员，中国民生银行金融市场部投资管理中心总经理助理、高级交易员。2017年11月加盟东方基金管理有限责任公司。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。历任 GCV 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。

王然女士，简历请参见基金经理介绍。

姚航女士，固定收益投资部副总经理，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、上述人员之间均不存在近亲属关系

### 三、基金托管人

#### (一) 基本托管人概况

##### 1、基本情况

名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）

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

成立时间: 1996年2月7日

基金托管业务批准文号: 证监基金字[2004]101号

组织形式: 其他股份有限公司(上市)

注册资本: 28,365,585,227元人民币

存续期间: 持续经营

电话: 010-58560666

联系人: 罗菲菲

中国民生银行是我国首家主要由非公有制企业入股的全国性股份制商业银行,同时又是严格按照《公司法》和《商业银行法》建立的规范的股份制金融企业。多种经济成份在中国金融业的涉足和实现规范的现代企业制度,使中国民生银行有别于国有银行和其他商业银行,而为国内外经济界、金融界所关注。中国民生银行成立二十年来,业务不断拓展,规模不断扩大,效益逐年递增,并保持了快速健康的发展势头。

2000年12月19日,中国民生银行A股股票(600016)在上海证券交易所挂牌上市。2003年3月18日,中国民生银行40亿可转换公司债券在上交所正式挂牌交易。2004年11月8日,中国民生银行通过银行间债券市场成功发行了58亿元人民币次级债券,成为中国第一家在全国银行间债券市场成功私募发行次级债券的商业银行。2005年10月26日,民生银行成功完成股权分置改革,成为国内首家完成股权分置改革的商业银行,为中国资本市场股权分置改革提供了成功范例。2009年11月26日,中国民生银行在香港交易所挂牌上市。

中国民生银行自上市以来,按照“团结奋进,开拓创新,培育人才;严格管理,规范行为,敬业守法;讲究质量,提高效益,健康发展”的经营发展方针,在改革发展与管理等方面进行了有益探索,先后推出了“大集中”科技平台、“两率”考核机制、“三卡”工程、独立评审制度、八大基础管理系统、集中处理商业模式及事业部改革等制度创新,实现了低风险、快增长、高效益的战略目标,树立了充满生机与活力的崭新的商业银行形象。

2013年度,民生银行荣获中国投资协会股权和创业投资专业委员会年度中国优秀股权和创业投资中介机构“最佳资金托管银行”及由21世纪传媒颁发的2013年PE/VC最佳金融服务托管银行奖。

2013年荣获中国内部审计协会民营企业内部审计优秀企业。

在第八届“21世纪亚洲金融年会”上,民生银行荣获“2013·亚洲最佳投资金融服务银行”大奖。

在“2013第五届卓越竞争力金融机构评选”中,民生银行荣获“2013卓越竞争力品牌建设银行”奖。

在中国社科院发布的《中国企业社会责任蓝皮书(2013)》中,民生银行荣获“中国企业上市公司社会责任指数第一名”、“中国民营企业社会责任指数第一名”、“中国银行业社会责任指数第一名”。

在2013年第十届中国最佳企业公民评选中,民生银行荣获“2013年度中国最佳企业公民大奖”。

2013年还获得年度品牌金博奖“品牌贡献奖”。

2014年获评中国银行业协会“最佳民生金融奖”、“年度公益慈善优秀项目奖”。

2014年荣获《亚洲企业管治》“第四届最佳投资者关系公司”大奖和“2014亚洲企业管治典范奖”。

2014年被英国《金融时报》、《博鳌观察》联合授予“亚洲贸易金融创新服务”称号。

2014年还荣获《亚洲银行家》“中国最佳中小企业贸易金融银行奖”,获得《21世纪经济报道》颁发的“最佳资产管理私人银行”奖,获评《经济观察报》“年度卓越私人银行”等。

2015年度,民生银行在《金融理财》举办的2015年度金融理财金貔貅奖评选中荣获“金牌创新力托管银行奖”。

2015年度,民生银行荣获《EUROMONEY》2015年度“中国最佳实物黄金投资银行”称号。

2015年度,民生银行连续第四次获评《企业社会责任蓝皮书(2015)》“中国银行业社会责任发展指数第一名”。

2015年度,民生银行在《经济观察报》主办的2014-2015年度中国卓越金融奖评选中荣获“年度卓越创新战略创新银行”和“年度卓越直销银行”两项大奖。

2016年度,民生银行荣获2016胡润中国新金融50强和2016中国最具创新模式新金融企业奖。

## 2、主要人员情况

张庆先生，中国民生银行资产托管部总经理，博士研究生，具有基金托管人高级管理人员任职资格，从事过金融租赁、证券投资、银行管理等工作，具有25年金融从业经历，不仅有丰富的一线实战经验，还有扎实的总部管理经验。历任中国民生银行西安分行副行长，中国民生银行沈阳分行筹备组组长、行长、党委书记。

## 3、基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于2004年7月9日获得基金托管资格，成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势，大力发展托管业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则，高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工70人，平均年龄37岁，100%员工拥有大学本科以上学历，65%以上员工具有硕士以上文凭。基金业务人员100%都具有基金从业资格。

中国民生银行坚持以客户需求为导向，秉承“诚信、严谨、高效、务实”的经营理念，依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台，为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。截至2018年9月30日，中国民生银行已托管178只证券投资基金。中国民生银行于2007年推出“托付民生·安享财富”托管业务品牌，塑造产品创新、服务专业、效益优异、流程先进、践行社会责任的托管行形象，赢得了业界的高度认可和客户的广泛好评，深化了与客户的战略合作。自2010年至今，中国民生银行荣获《金融理财》杂志颁发的“最具潜力托管银行”、“最佳创新托管银行”、“金牌创新力托管银行”奖和“年度金牌托管银行”奖，荣获《21世纪经济报道》颁发的“最佳金融服务托管银行”奖。

### (二) 基金托管人的内部控制制度说明

#### 1、内部风险控制目标

强化内部管理，保障国家的金融方针政策及相关法律法规贯彻执行，保证自觉合规依法经营，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系，保障业务正常运行，维护基金份额持有人及基金托管人的合法权益。

#### 2、内部风险控制组织结构

中国民生银行股份有限公司基金托管业务内部风险控制组织结构由中国民生银行股份有限公司审计部、资产托管部内设风险监督中心及资产托管部各业务中心共同组成。总行审计部对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内设独立、专职的风险监督中心,负责拟定托管业务风险控制工作总体思路与计划,组织、指导、协调、监督各业务中心风险控制工作的实施。各业务中心在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### 3、内部风险控制原则

(1) 全面性原则:风险控制必须覆盖资产托管部的所有中心和岗位,渗透各项业务过程和业务环节;风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(2) 独立性原则:资产托管部设立独立的风险监督中心,该中心保持高度的独立性和权威性,负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

(3) 相互制约原则:各中心在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制,建立不同岗位之间的制衡体系。

(4) 定性和定量相结合原则:建立完备的风险管理指标体系,使风险管理更具客观性和操作性。

(5) 防火墙原则:托管部自身财务与基金财务严格分开;托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

### 4、内部风险控制制度和措施

(1) 制度建设:建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2) 建立健全的组织管理结构:前后台分离,不同部门、岗位相互牵制。

(3) 风险识别与评估:风险监督中心指导业务中心进行风险识别、评估,制定并实施风险控制措施。

(4) 相对独立的业务操作空间:业务操作区相对独立,实施门禁管理和音像监控。

(5) 人员管理:进行定期的业务与职业道德培训,使员工树立风险防范与控制理念,并签订承诺书。

(6) 应急预案:制定完备的《应急预案》,并组织员工定期演练;建立异

地灾备中心, 保证业务不中断。

#### 5、资产托管部内部风险控制

中国民生银行股份有限公司从控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、监控等五个方面构建了托管业务风险控制体系。

(1) 坚持风险管理与业务发展同等重要的理念。托管业务是商业银行新兴的中间业务, 中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作, 一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展, 新问题新情况不断出现, 中国民生银行股份有限公司资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置, 视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(2) 实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与, 只有这样, 风险控制制度和措施才会全面、有效。中国民生银行股份有限公司资产托管部实施全员风险管理, 将风险控制责任落实到具体业务中心和业务岗位, 每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(3) 建立分工明确、相互牵制的风险控制组织结构。托管部通过建立纵向双人制, 横向多中心制的内部组织结构, 形成不同中心、不同岗位相互制衡的组织结构。

(4) 以制度建设作为风险管理的核心。中国民生银行股份有限公司资产托管部十分重视内部控制制度的建设, 已经建立了一整套内部风险控制制度, 包括业务管理办法、内部控制制度、员工行为规范、岗位职责及涵括所有后台运作环节的操作手册。以上制度随着外部环境和业务的发展还会不断增加和完善。

(5) 制度的执行和监督是风险控制的关键。制度执行比编写制度更重要, 制度落实检查是风险控制管理的有力保证。中国民生银行股份有限公司资产托管部内部设置专职风险监督中心, 依照有关法律规章, 定期对业务的运行进行稽核检查。总行审计部也不定期对资产托管部进行稽核检查。

(6) 将先进的技术手段运用于风险控制中。在风险管理中, 技术控制风险比制度控制风险更加可靠, 可将人为不确定因素降至最低。托管业务系统需求不仅从业务方面而且从风险控制方面都要经过多方论证, 托管业务技术系统具有较强的自动风险控制功能。

### (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

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规的规定,对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为,应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

## 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

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认购、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](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://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](http://www.nesc.cn)

2、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](http://www.dxzq.net)

3、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](http://www.gjzq.com.cn)

4、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:单丙焜

电话:021-20691832

传真:021-20691861

客户服务电话:400 820 2899

网址:www.erichfund.com

5、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

6、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

7、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

8、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

9、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

10、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](http://www.niuji.net)

11、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](http://8.jrj.com.cn)

12、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](http://www.5ifund.com)

13、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](http://www.zcvc.com.cn)

14、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](http://www.leadfund.com.cn)

15、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](http://www.chtfund.com)

16、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](http://www.lufunds.com)

17、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](http://www.hongdianfund.com)

18、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](http://www.chinapnr.com)

19、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](http://www.noah-fund.com)

20、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

21、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

22、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

23、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

24、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

25、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

26、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](http://www.fengfd.com)

#### 27、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](http://www.qiandaojr.com)

#### 28、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](http://www.jinqianwo.cn)

#### 29、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

30、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

31、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

32、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](http://www.keynesasset.com)

### 33、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](http://www.buyfunds.cn)

### 34、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](http://www.jianfortune.com)

### 35、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](http://www.jhjhome.com)

36、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](http://www.fhcfjj.com)

37、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中路3号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路3号

联系人：徐江

电话：18840800358

客服电话：400-0411-001

网址：[www.haojiyoujijin.com](http://www.haojiyoujijin.com)

**(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：李进康

电话：010-66295874

传真：010-66578680

网址：[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com)

**(四) 出具法律意见书的律师事务所**

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

联系人: 陆奇

电话: 021-31358666

传真: 021-31358600

经办律师: 黎明、陆奇

#### **(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: 东方盛世灵活配置混合型证券投资基金

(二) 本基金类型: 混合型

(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

严格控制投资风险, 采取灵活动态的资产配置策略, 力争为投资人提供长期稳健的回报。

(二) 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含中小企业私募债券)、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需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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、应收申购款等。

## 七、基金的投资策略

本基金采用灵活的类别资产配置,并在此基础上精选具有投资价值的股票和债券,在严格控制风险的基础上,获得基金的长期稳定的投资回报。

### (一) 类别资产配置

在类别资产的配置上,本基金结合宏观经济因素、市场估值因素、政策因素、市场情绪因素等分析各类资产的市场趋势和收益风险水平,进而对股票、债券和货币市场工具等类别的资产进行动态调整。

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。

### (二) 股票投资策略

在灵活配置类别资产的基础上,本基金通过分析股票市场的中长期趋势并结

合股票市场短期特征,选取具备中长期投资价值的个股和当前股票市场中具备潜在投资价值的行业和个股。

### 1、行业配置策略

本基金将采用“自上而下”的行业配置方法,通过对国家宏观经济走势、国家产业政策导向、经济结构转型方向、行业自身生命周期与行业技术创新情况等深入研究,综合评判行业的成长性和投资价值。同时,根据上述因素的变化对行业进行动态筛选和配置。

### 2、个股配置策略

#### (1) 价值投资策略

价值投资策略是通过寻找价值被低估的股票进行投资,以谋求估值反转带来的收益。通过运用多项指标如PE、PB、EV/EBITDA等进行相对估值,通过与国内同行业其它公司估值水平以及国外同行业公司相对估值水平等进行估值比较,找出价值被相对低估的公司。

#### (2) 趋势投资策略

公司的经营业绩成长和公司投资价值的提升决定了公司股票价格的长期趋势;同时由于受到当期各种外部因素的影响,股票价格还具有中、短期趋势,表现为股价相对长期趋势的估值偏离和估值修复过程。由于市场反应不足或反应过度,股票价格的涨跌往往表现出一定的惯性。因此,可通过基本面分析、行为金融分析和事件分析,利用股价中、短期趋势的动态特征,进行股票的买入和卖出操作,从而提高单只股票的投资收益。

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

### 3、类属债券配置策略

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。本基金将通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求状况、信用风险状况等因素进行综合分析,在目标久期控制及期限结构配置基础上,采取积极投资策略,确定类属债券的最优配置比例。

#### (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、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。

### 5、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。

### 6、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,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。

### 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:沪深300指数收益率 $\times$ 30%+中债总全价指数收益率 $\times$ 70%

选择该业绩比较基准的理由主要如下:

本基金的投资目标是力争为投资人提供长期稳健的回报,以“沪深300指数收益率 $\times$ 30%+中债总全价指数收益率 $\times$ 70%”作为业绩比较基准可以较好地反映本基金的投资目标。

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,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2018年9月30日。

(一) 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	34,446,406.15	16.30
	其中:股票	34,446,406.15	16.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	123,260,189.22	58.31
	其中:债券	123,260,189.22	58.31
	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	50,080,275.12	23.69
	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	176,749.78	0.08
8	其他各项资产	3,423,256.07	1.62
9	合计	211,386,876.34	100.00

(二) 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	16,600,606.15	7.88
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	-	-
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	12,594,900.00	5.98
K	房地产业	2,242,800.00	1.06
L	租赁和商务服务业	2,040,600.00	0.97
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	967,500.00	0.46
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	34,446,406.15	16.36

(三) 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	601318	中国平安	70,000	4,795,000.00	2.28
2	603288	海天味业	60,000	4,752,000.00	2.26
3	600276	恒瑞医药	50,000	3,175,000.00	1.51
4	601398	工商银行	550,000	3,173,500.00	1.51
5	601288	农业银行	800,000	3,112,000.00	1.48
6	002507	涪陵榨菜	99,963	2,604,036.15	1.24
7	001979	招商蛇口	120,000	2,242,800.00	1.06
8	600519	贵州茅台	3,000	2,190,000.00	1.04
9	601888	中国国旅	30,000	2,040,600.00	0.97
10	600436	片仔癀	19,500	1,974,570.00	0.94

(四) 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	30,072,308.40	14.28
	其中:政策性金融债	30,072,308.40	14.28
4	企业债券	72,722,600.00	34.53
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,360,000.00	9.67
7	可转债(可交换债)	105,280.82	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	123,260,189.22	58.53

(五) 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	180210	18 国开 10	200,000	19,746,000.00	9.38
2	136689	16 绿水 01	150,000	14,802,000.00	7.03
3	1480582	14 海控债 02	100,000	10,260,000.00	4.87
4	124251	13 鲁信投	100,000	10,214,000.00	4.85
5	101355012	13 龙岩交通 MTN001	100,000	10,206,000.00	4.85

(六) 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。

(七) 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。

(八) 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。

(九) 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。

(十) 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。

(十一) 投资组合报告附注

1、本基金所持有的片仔癀(600436)于2017年8月24日公告,公司涉及一项商标侵权纠纷,该案已由福建省漳州市中级人民法院受理。案件内容为:

“(1) 诉讼案件基本情况:被告厦门中药厂在报刊、自己的药品宣传中对片仔癀大肆侵权,利用广告、虚构事实、不正当对比、诋毁挤压片仔癀药品,做引人误解的虚假宣传等行为构成不正当竞争,侵犯了本公司(即原告)的注册商标合法权益,根据《中华人民共和国反不正当竞争法》、《中华人民共和国商标法》的规定,应承担法律责任;厦门晚报、厦门日报不尊重法律和事实,对厦门中药厂的商标侵权和不正当竞争行为作不客观的报道,也应承担连带的法律责任。

(2) 诉讼请求:1、被告厦门中药厂有限公司立即停止其产品“八宝丹”在中国

大陆、香港、印尼等国家和地区作引人误解的虚假宣传;立即停止将“片仔癀”与“八宝丹”作不正当的对比等虚假宣传;在全国主流媒体、报刊、香港、印尼等国家和地区报刊、厦门晚报、厦门日报刊登“声明”,进行公开赔礼道歉,消除影响。上述“声明”的内容及刊登的版面须经原告书面认可。2、立即销毁使用前述虚假宣传的物品、相关的产品包装装潢。3、厦门晚报在原版面位置以及在《厦门日报》头版、厦门日报社在原版面位置对不实报道刊登道歉声明,消除影响。4、被告厦门中药厂有限公司赔偿原告人民币3000万元,并支付原告维权费用60万元,厦门晚报和厦门日报承担连带赔偿责任。”

公司公告以上内容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) 研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究,形成有关的各类报告,为本基金的投资管理提供决策依据。
- (2) 投资决策委员会定期召开会议,讨论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范围形成本基金的资产配置比例指导意见。
- (3) 基金经理根据投资决策委员会的决议,参考上述报告,并结合自身的分析判断,形成基金投资计划,主要包括行业配置和投资组合管理。
- (4) 交易部依据基金经理的指令,制定交易策略,统一进行具体品种的交易;基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。
- (5) 投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施,监察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资片仔癀主要基于以下原因:公司为我国绝密配方片仔癀拥有者,具备明显的产品优势和长期的品牌优势,公司具备定价权,业绩长期稳健增长,财务指标良好,是具备长期投资价值的品牌中药公司。

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、报告期末其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
----	----	-------

1	存出保证金	78,954.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,344,301.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,423,256.07

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113013	国君转债	104,600.00	0.05
2	127006	敖东转债	680.82	0.00

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的情况。

## 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。

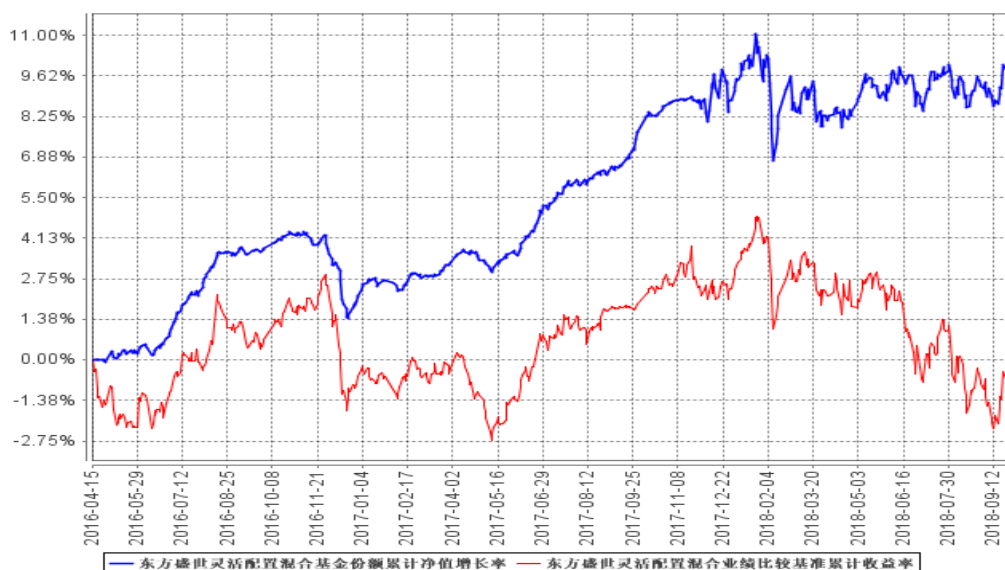
(一) 基金的净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2016.04.15-2016.12.31	2.16%	0.11%	-0.57%	0.29%	2.73%	-0.18%
2017.01.01-2017.12.31	6.51%	0.14%	3.01%	0.20%	3.50%	-0.06%
2018.01.01-2018.06.30	0.25%	0.32%	-1.88%	0.34%	2.13%	-0.02%
2018.07.01-2018.09.30	1.25%	0.23%	-0.38%	0.40%	1.63%	-0.17%

(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

东方盛世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



## 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、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

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

### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费每日按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：



$$H=E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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《东方盛世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”部分,更新了“招募说明书有关财务数据的截止日期”及“其他内容的截止日期”。

(二)在“第三部分 基金管理人”部分,更新了基金管理人的相关内容。

(三)在“第四部分 基金托管人”部分,更新了基金托管人的相关内容。

(四)在“第五部分 相关服务机构”中,更新了相关服务机构的信息。

(五)在“第八部分 基金的投资”部分,更新了“投资组合报告”的内容,基金投资组合报告截止日期更新为2018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。

(六)在“第九部分 基金的业绩”部分,更新了“基金的净值表现”和“本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”,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”部分,更新了自上次招募说明书(更新)截止日2018年4月15日,至本次招募说明书(更新)截止日2018年10月15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](http://www.orient-fund.com)。

---

东方基金管理有限责任公司  
2018年11月