

东方多策略灵活配置混合型证券投资基金  
招募说明书（更新）  
（2020年第4号）

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

## 重要提示

东方多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2014 年 4 月 29 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准东方多策略灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2014]443 号）和《关于东方多策略灵活配置混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》（证券基金机构监管部部函[2014]151 号）准予募集注册。本基金基金合同于 2014 年 5 月 21 日正式生效。

东方基金管理有限责任公司（以下简称“本基金管理人”）保证《东方多策略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。

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。

基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

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产品资料概要，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。

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。

本基金管理人于2015年11月13日在指定媒介和本基金管理人公司网站发布《关于东方多策略灵活配置混合型证券投资基金增加C类基金份额并修改基金合同的公告》，本基金于2015年11月13日起增加收取销售服务费的C类基金份额，并对本基金的基金合同作相应修改。上述公告可通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及东方基金管理有限责任公司网站查阅。修订后的基金合同、托管协议可通过东方基金管理有限责任公司网站查阅。

本基金管理人于2016年11月4日至2016年12月5日以通讯方式召集东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会，审议《关于调整东方多策略灵活配置混合型证券投资基金管理费率并修改基金合同与托管协议的议案》。本基金管理人于2016年12月6日完成基金份额持有人大会的计票，表决通过了上述议案，自2016年12月6日起，本基金开始实行新的管理费率。本基金管理人于2016年12月7日在指定媒介披露了《东方基金管理有限责任公司关于东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，详可查阅东方基金管理有限责任公司网站。

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。

根据中国证监会 2019 年 9 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的要求，经与相关基金托管人协商一致，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，报监管部门备案并按规定在指定媒介上公告。

有关财务数据和净值表现截止日为 2020 年 3 月 31 日（财务数据未经审计），本招募说明书中关于基金管理人基本情况事项的内容截止日为 2020 年 5 月 25 日，如无其他特别说明，本招募说明书其他所载内容截止日为 2020 年 5 月 21 日。

## 目 录

第一部分、绪言.....	1
第二部分、释义.....	2
第三部分、基金管理人.....	7
第四部分、基金托管人.....	21
第五部分、相关服务机构.....	27
第六部分、基金的募集与合同生效.....	56
第七部分、基金份额的申购与赎回.....	57
第八部分、基金的投资.....	67
第九部分、基金的业绩.....	82
第十部分、基金的财产.....	84
第十一部分、基金资产估值.....	85
第十二部分、基金收益与分配.....	90
第十三部分、基金的费用与税收.....	92
第十四部分、基金的会计与审计.....	95
第十五部分、基金的信息披露.....	96
第十六部分、风险揭示.....	103
第十七部分、基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	106
第十八部分、基金合同的内容摘要.....	108
第十九部分、基金托管协议的内容摘要.....	122
第二十部分、对基金份额持有人的服务.....	136
第二十一部分、其他应披露事项.....	139
第二十二部分、招募说明书存放及查阅方式.....	141
第二十三部分、备查文件.....	142



## 第一部分、绪 言

《东方多策略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”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)及其他有关规定以及《东方多策略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”)编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件,其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,均以基金合同为准。基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依基金合同取得本基金基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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。

## 第二部分、释 义

在《东方多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》中，除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指东方多策略灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指东方基金管理有限责任公司
- 3、基金托管人：指中国工商银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《东方多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《东方多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金产品资料概要：指《东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 8、基金份额发售公告：指《东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，并经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《运作办法》：指2014年7月7日由中国证监会公布并于2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及不时做出的修订



14、《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

17、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

19、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

20、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

21、投资人：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

22、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

23、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

24、销售机构：指东方基金管理有限责任公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

25、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

26、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为东方基金管理有限责任公司或接受东方基金管理有限责任公司委托代为办理登记业务的机构

27、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

28、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

29、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

30、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

31、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

32、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

33、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

35、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

36、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

37、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

38、《业务规则》：指《东方基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人 and 投资人共同遵守

39、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

40、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

41、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

42、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

43、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所

## 持基金份额销售机构的操作

44、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

45、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

46、元：指人民币元

47、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

48、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

49、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

50、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

51、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

52、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

53、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”，包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

54、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

55、销售服务费：指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广、持续销售以及基金份额持有人服务的费用

56、基金份额类别：指本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取前端申购费用、赎

回时收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；在投资人申购时不收取申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额

## 第三部分、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：叁亿叁仟叁佰叁拾叁万元人民币

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	19200 万元	57.60%
河北国控资本管理有限公司	8100 万元	24.30%
渤海国际信托股份有限公司	2700 万元	8.10%
天津汇智长行企业管理咨询中心（有限合伙）	1170 万元	3.51%
天津汇远长行企业管理咨询中心（有限合伙）	1123 万元	3.37%
天津汇聚长行企业管理咨询中心（有限合伙）	1040 万元	3.12%
合 计	33333 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、估值委员会、反洗钱工作组和权益投资部、权益研究部、固定收益投资部、固定收益研究部、量化投资部、专户投资部、市场部、产品开发部、机构业务一部、战略客户部、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

### （一）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，中国证监会党组书记、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，中国证券投资基金业协会第一届理事；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、中国证券投资基金业协会第二届监事、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。

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，兼任吉林省证券业协会副会长，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长，东证融汇证券资产管理有限公司董事。

李雪飞先生，董事，硕士。曾任吉林建设开发集团公司党委文书，吉林省国际信托投资公司职员，华泰证券股份有限公司长春同志街营业部交易部经理、总

经理助理，东北证券股份有限公司长春自由大路证券营业部总经理、长春同志街第三证券营业部总经理、营销管理部总经理、客户服务部总经理、机构业务部总经理、总裁助理、经纪业务发展与管理委员会副主任、金融产品部总经理、职工监事、东证融达投资有限公司董事；现任东北证券股份有限公司党委委员、副总裁、经纪业务发展与管理委员会主任，兼任东证融汇证券资产管理有限公司董事长、渤海期货股份有限公司董事。

王真女士，董事，工商管理硕士。曾任沧州日报社记者，燕赵都市报经济新闻部主任，河北青年报社副总编辑，河北建设投资集团有限公司集团办公室副主任，河北省国有资产控股运营有限公司战略投资部部长；现任河北省国有资产控股运营有限公司总裁助理、资本运营总监，兼任河北国控资本管理有限公司党委书记、董事长。

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，长华化学科技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，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；现任公司总经理兼首席信息官。

## （二）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。

周鑫先生，监事，硕士研究生。曾任职北京时代博讯高科技有限公司、太平洋证券有限责任公司、北京航天辰光精密仪器有限公司等机构；现任东方基金管理有限责任公司综合管理部总经理兼人力资源部总经理。

王丹丹女士，监事，硕士研究生。曾任职银瑞信基金管理有限公司、英大基金管理有限公司；现任东方基金管理有限责任公司产品开发部总经理兼运营部总经理、交易部总经理。

## （三）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，总经理兼首席信息官，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。



(四) 本基金基金经理

姓名	任职时间	简历
车日楠(女士)	2020年5月11日至今	北京交通大学计算数学专业硕士,5年证券从业经历。2015年加盟东方基金管理有限责任公司,曾任固定收益研究部研究员、交易部债券交易员,东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方成长回报平衡混合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、东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理,现任东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理。
周薇(女士)	自2019年3月1日至2020年5月13日任本基金基金经理。	
黄诺楠(女士)	自2017年4月12日至2019年3月8日任本基金基金经理。	
朱晓栋(先生)	自2014年5月21日至2018年12月28日任本基金基金经理。	
徐昀君(先生)	自2014年5月21日至2017年5月12日任本基金基金经理。	
姚航(女士)	自2014年5月21日至2015年12月15日任本基金基金经理。	

(五) 投资决策委员会成员

刘鸿鹏先生，总经理兼首席信息官，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，19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公司，曾任东方双债添利债券型证券投资基金基金经理，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、东方龙混合型开放式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。

杨贵宾先生，公司总经理助理、固定收益投资总监、投资决策委员会委员。西安交通大学应用经济学博士，15年投资从业经历。曾任富国基金管理有限公司固定收益研究员、基金经理，上海海通证券资产管理有限责任公司投资主办、固定收益投资总监、公司总助职位。2019年9月加盟东方基金管理有限公司，现任东方双债添利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，10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公司，曾任研究部总经理，东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理，现任东方主题精选混合型证券投资基金基金经理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理、东方创新科技混合型证券投资基金基金经理、东方人工智能主题混合型证券投资基金基金经理。

王然女士，权益研究部副总经理，投资决策委员会委员，北京交通大学产业经济学硕士，12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证券投资基金）基金经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方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、东方大健康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、东方城镇消费主题混合型证券投资基金基金经理。

吴萍萍女士，固定收益投资部副总经理，投资决策委员会委员，中国人民大学应用经济学硕士，9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月加盟东方基金管理有限责任公司，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、东方添益债券型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（于2019年8月2日起转型为东方成长回报平衡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、东方成长回报平衡混合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、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理，现任东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理、东方永泰纯债1年定期开放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、东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理、东方卓行18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方永悦18个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻萃3个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。

（六）上述人员之间均不存在近亲属关系

### 三、基金管理人职责

#### (一) 基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- 1、依法募集资金；
- 2、自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- 3、依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- 4、销售基金份额；
- 5、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 6、依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- 7、在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- 8、选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- 9、担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获取《基金合同》规定的费用；
- 10、依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- 11、在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- 12、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- 13、在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
- 14、以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 15、选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- 16、在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

17、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

## (二) 基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7、依法接受基金托管人的监督；

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度报告、中期报告和年度报告；

11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

13、按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15、依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

18、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

20、因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21、监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

23、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

26、建立并保存基金份额持有人名册；

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### **四、基金管理人的承诺**

(一) 本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行

有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会有关规定的行为发生。

(二) 本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- 1、将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
- 2、不公平地对待其管理的不同基金财产；
- 3、利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
- 4、向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- 5、法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

(三) 本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- 1、越权或违规经营；
- 2、违反《基金合同》或托管协议；
- 3、故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法利益；
- 4、在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- 5、拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- 6、玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
- 7、违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- 8、违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- 9、贬损同行，以抬高自己；
- 10、以不正当手段谋求业务发展；
- 11、有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- 12、在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- 13、其他法律法规以及中国证监会禁止的行为。

(四) 基金经理承诺

1、依照有关法律法规和《基金合同》的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

- 2、不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- 3、不违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- 4、不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## 五、基金管理人的内部控制制度

### (一) 内部控制的原则

- 1、健全性原则：内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。
- 2、有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。
- 3、独立性原则：公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。
- 4、相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。
- 5、成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

### (二) 内部控制的主要内容

#### 1、控制环境

(1)控制环境构成公司内部控制的基础，环境控制包括管理思想、经营理念、控制文化、公司治理结构、组织结构和员工道德素质等内容。

(2)管理层通过定期学习、讨论、检讨内控制度，组织内控设计并以身作则、积极执行，牢固树立诚实信用和内控优先的思想，自觉形成风险管理观念；通过营造公司内控文化氛围，增进员工风险防范意识，使其贯穿于公司各部分、岗位和业务环节。

(3)董事会负责公司内部控制基本制度的制定和内控工作的评估审查，对公司建立有效的内部控制系统承担最终责任；同时，通过充分发挥独立董事和监事会的监督职能，避免不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，建立健全符合现代企业制度要求的法人治理结构。



(4) 建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主透明的决策程序和管理议事规则，高效严谨的业务执行系统，以及健全有效的内部监督和反馈系统。

(5) 建立科学的聘用、培训、轮岗、考评、晋升、淘汰等人事管理制度，严格制定单位业绩和个人工作表现挂钩的薪酬制度，确保公司职员具备和保持正直、诚实、公正、廉洁的品质与应有的专业能力。

## 2、风险评估

公司定期评估公司风险状况，范围包括所有能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对公司总体经营目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司董事会及高级管理人员。

## 3、组织体系

内部控制组织体系包括三个层次：

第一层次：董事会层面对公司经营管理过程中的风险控制工作的指导；

公司董事会通过其下设的合规与风险控制委员会、督察长对公司和基金的合法合规性进行监督。

合规与风险控制委员会代表董事会在董事会授权范围内对公司和基金运作的合法合规性及风险控制状况进行评估，并督促经理层、督察长落实或改进。

督察长根据法律法规的规定，监督检查基金和公司运作的合法合规及公司内部风险控制情况，行使法律法规及中国证监会和公司章程规定的职权。

第二层次：公司管理层对经营风险进行预防和控制的组织主要是总经理办公会、风险控制委员会和风险与监察稽核部门；

(1) 总经理办公会为公司经营重大事项之决策机构，并负责公司层面风险管理工作。

(2) 风险控制委员会是公司基金投资及资产管理的最高风险控制机构。风险控制委员会的主要职权是拟定基金投资风险控制的基本制度和标准，划分和量化市场风险，并进行基金投资组合的风险评估和业绩评价。

(3) 风险与监察稽核部门，负责对公司、基金运作和资产管理的合法合规性、内部控制制度的有效性及公司日常风险和基金投资的绩效评价进行风险管理、监察、稽核。

第三层次：各职能部门对各自业务的自我检查和控制。

公司各业务部门作为公司内部风险控制的具体实施单位，在公司各项基本管理制度的基础上，根据具体情况制订和执行本部门的业务管理办法和操作流程，对各自业务中潜在风险进行自我检查和控制。

#### 4、制度体系

制度是内部控制的指引和规范，制度缜密是内部控制体系的基础。

(1) 内部控制制度包括内部管理控制制度、业务控制制度、会计核算控制制度、信息披露制度、监察稽核制度等。

(2) 内部管理控制制度包括授权管理制度、人力资源及业绩考核制度、行政管理制度、员工行为规范、纪律程序。

(3) 业务控制制度包括投资管理制度、风险控制制度、资料档案管理制度、技术保障制度和危机处理制度。

#### 5、信息与沟通

建立内部办公自动化信息系统与业务汇报体系，通过建立有效的信息交流渠道，保证公司员工及各级管理人员可以充分了解与其职责相关的信息，保证信息及时送达适当的人员进行处理。

#### (三) 基金管理人关于内部控制制度的声明

1、基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；

2、上述关于内部控制制度的披露真实、准确；

3、基金管理人承诺将根据市场环境的变化及基金管理人不断发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分、基金托管人

### 一、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

### 二、主要人员情况

截至 2018 年 6 月，中国工商银行资产托管部共有员工 212 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### 三、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2018 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 874 只。自 2003 年以来，本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选

的 61 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

#### 四、基金托管人的职责

- 1、以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- 2、设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- 3、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- 4、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- 5、保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- 6、按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 7、保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- 8、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；
- 9、办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 10、对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- 11、保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- 12、建立并保存基金份额持有人名册；
- 13、按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- 14、依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

- 15、按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- 16、按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；
- 17、参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 18、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- 19、因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 20、按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；
- 21、执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- 22、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## 五、基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。从2005年至今共十二次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对中国工商银行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监

控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

## 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室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）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

## 4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，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，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

## 5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，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。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，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，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，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。

## 六、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》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金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，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。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。



## 第五部分、相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### (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：王丹

电话：010—66295876

传真：010—66578690

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

##### 2、中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

客服电话：95599

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

3、中国民生银行股份有限公司

住所: 北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人: 洪崎

客服电话: 95568

网址: [www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

4、招商银行股份有限公司

住所: 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

法定代表人: 李建红

联系人: 邓炯鹏

电话: 0755-83077278

传真: 0755-83195109

客服电话: 95555

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

5、中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街3号

办公地址: 北京市西城区金融大街3号

法定代表人: 张金良

联系人: 王硕

传真: 010-68858057

客服电话: 95580

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

6、东莞银行股份有限公司

住所: 东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦

办公地址: 东莞市莞城区体育路21号东莞银行大厦

法定代表人: 廖玉林

联系人: 陈幸

电话: 0769-22119061

传真：0769-22117730

客服电话：4001196228（全国）、96228（广东省内）

网址：[www.dongguanbank.cn](http://www.dongguanbank.cn)

#### 7、吉林银行股份有限公司

住所：吉林省长春市东南湖大路 1817 号

办公地址：吉林省长春市东南湖大路 1817 号

法定代表人：唐国兴

联系人：孟明

电话：0431-84992680

传真：0431-84992649

客服电话：400-88-96666(全国)、96666(吉林省)

网址：[www.jlbank.com.cn](http://www.jlbank.com.cn)

#### 8、晋商银行股份有限公司

住所：山西省太原市长风西街 1 号丽华大厦 A 座

办公地址：山西省太原市小店区长风街 59 号

联系人：董嘉文

电话：0351-6819505

传真：0351-6819898

客户服务电话：95105588

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

#### 9、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](http://www.95579.com)

#### 10、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)

#### 11、东海证券股份有限公司

注册地址：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：钱俊文

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

客服电话：95531；400-8888-588

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

#### 12、东莞证券股份有限公司

住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 30 楼

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

联系人：孙旭

电话：0769-22119348

客服电话：961130（省内直拨，省外请加拨区号 0769）

网址：[www.dgzq.com.cn](http://www.dgzq.com.cn)

#### 13、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：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

#### 14、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

#### 15、海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

电话：021-23219275

传真：021-23219100

客服电话：021-95553、400-8888-001 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：www.htsec.com

#### 16、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](http://www.hazq.com)

17、华泰证券股份有限公司

住所: 江苏省南京市江东中路 228 号

办公地址: 南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼

法定代表人: 周易

联系人: 庞晓芸

电话: 0755-82492193

传真: 0755-82492962

客服电话: 95597

网址: [www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

18、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](http://www.cfsc.com.cn)

19、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](http://www.jhzq.com.cn)

20、粤开证券股份有限公司

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：严亦斌

联系人：彭莲

电话：0755-83331195

客服电话：95564

网址：www.lxsec.com

#### 21、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

#### 22、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

#### 23、山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

客服电话：400-666-1618

网址：www.i618.com.cn

24、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：陈宇

电话：021-33388214

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

25、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：陈宇

电话：021-33388214

传真：021-33388224

客服电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

26、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

客服电话：40018-40028

网址：[www.wkzq.com.cn](http://www.wkzq.com.cn)

27、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](http://www.xyzq.com.cn)

28、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](http://www.newone.com.cn)

29、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](http://www.chinastock.com.cn)

30、中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

办公地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层

法定代表人：林炳城

联系人：罗艺琳

电话：0755-82943755

传真：0755-82960582

客服电话：95329

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

31、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](http://www.csc108.com)

32、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](http://www.zxwt.com.cn)

33、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

34、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

35、中国国际金融股份有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇

电话：010-65051166

传真：010-85679203

客服电话：400-910-1166

网址：www.cicc.com.cn

36、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

37、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

38、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

39、华龙证券股份有限公司

住所：兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼

办公地址：兰州市城关区东岗西路638号19楼

法定代表人：李晓安

联系人：范坤

电话：0931-4890208

传真：0931-4890628

客户服务电话：95368

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

#### 40、华金证券股份有限公司

住所: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路759号30层

办公地址: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路759号30层

联系人: 郑媛

电话: 021-20655746

客户服务电话: 4008211357

网址: <https://www.huajinsc.cn>

#### 41、民生证券股份有限公司

住所: 北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层

办公地址: 北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层

联系人: 韩秀萍

电话: 010-85127999

传真: 010-85127888

客户服务电话: 95376

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

#### 42、阳光人寿保险股份有限公司

注册地址: 海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层

办公地址: 北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层

法定代表人: 李科

客户服务电话: 95510

网址: <http://fund.sinosig.com/>

#### 43、大连网金基金销售有限公司

住所: 辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室

办公地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室

法人代表: 樊怀东

联系人: 于秀

电话: 0411-39027810

传真: 0411-39027835

客户服务热线: 4000-899-100

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

44、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: 单丙焯

电话: 021-20691832

传真: 021-20691861

客户服务电话: 400 820 2899

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

45、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](http://www.fund123.cn)

46、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](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

47、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

48、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：屠彦洋

电话：021-54509998-2010

传真：021-64385308

客户服务电话：400 1818 188

网址：www.1234567.com.cn

49、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

50、中国国际期货有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层

办公地址：北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层

法定代表人：王兵

联系人：许黎婧

电话: 010-65807848

传真: 010-59539806

客服电话: 95162 或 400 888 8160

网址: [www.cifco.net](http://www.cifco.net)

51、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)

52、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)

53、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

54、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

55、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

56、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

57、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

58、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

59、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

60、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)

61、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](http://www.lingxianfund.com)

62、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

63、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](http://www.fundhaiyin.com)

## 64、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](http://www.66zichan.com)

## 65、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](http://www.fundzone.cn)

## 66、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)

## 67、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)

68、深圳富济基金销售有限公司

住所：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元

办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单

元

法定代表人：刘鹏宇

联系人：刘勇

电话：0755-83999907-8814

传真：0755-83999926

客户服务电话：0755-83999907

网址：[www.jingianwo.cn](http://www.jingianwo.cn)

69、北京肯特瑞财富基金销售有限公司

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](http://fund.jd.com)

70、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](http://www.jiyufund.com.cn)

71、一路财富（北京）基金销售股份有限公司

住所：北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室

办公地址：北京市海淀区奥北科技园-国泰大厦9层

法定代表人：吴雪秀

联系人：吕晓歌

电话：010-88312877

传真：010-88312099

客服电话：400-001-1566

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

72、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](http://www.amcfortune.com)

73、嘉实财富管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10

单元

办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层

法定代表人：赵学军

联系人：余永健

电话：010-85097570

传真：010-85097308

客户服务电话：400-021-8850

网址：[www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn)

74、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](http://www.zzwealth.cn)

75、奕丰基金销售有限公司

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](http://www.ifastps.com.cn)

76、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)

77、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)

78、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)

79、方德保险代理有限公司

住所: 北京市东城区东直门南大街 3 号楼 7 层 711

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: 010-64068617

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

80、天津市润泽基金销售有限公司

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

81、北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人：钟斐斐

联系人：侯芳芳

电话：010-61840688

客服电话：400-159-9288

网址：danjuanapp.com

82、中民财富基金销售（上海）有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 27 层

法定代表人：弭洪军

联系人：黄鹏

电话：18521506916

客服电话：400-876-5716

网址：www.cmiwm.com

83、南京苏宁基金销售有限公司

住所：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：南京市玄武区徐庄软件园苏宁大道 1 号

法定代表人：王锋

联系人：张云飞

电话：13016933367

客服电话：025-66996699

网址：www.snjijin.com

## 84、西藏东方财富证券股份有限公司

住所：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

法定代表人：陈宏

联系人：付佳

电话：17717379005

客服电话：95357

网址：www.18.cn

## 85、江苏汇林保大基金销售有限公司

住所：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路 105 号中环国际 1413 室

法定代表人：吴言林

联系人：孙平

电话：13564999938

客服电话：025-66046166

网址：www.huilinbd.com

## 86、深圳前海财厚基金销售有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：广东省深圳市南山区高新南十道 深圳湾科技生态园三区 11 栋 A 座 3608 室

法定代表人：杨艳平

联系人：莫婉

电话：13923830997

客服电话：400-1286-800

网址：www.caiho.cn

## 87、喜鹊财富基金销售有限公司

住所：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

办公地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

法定代表人：陈皓

联系人：张萌

联系电话：18600730680

客服电话：400-6997-719

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

88、中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法定代表人：钱昊旻

联系人：沈晨

电话：010-59336544

客服电话：4008-909-998

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

89、玄元保险代理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室

法定代表人：马永谔

联系人：卢亚博

电话：137-5252-8013

客服电话：400-080-8208

网址：[www.licaimofang.cn](http://www.licaimofang.cn)

90、和耕传承基金销售有限公司

住所：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北6号楼5楼503

办公地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北6号楼5楼

503

法定代表人：温丽燕

联系人：胡静华

联系电话：18638787099

客服电话：4000555671

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

91、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](http://www.dtfunds.com)

92、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)

注：为维护投资者利益，东方基金管理有限责任公司已暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司、大泰金石基金销售有限公司办理本公司旗下基金的认购、申购、定期定额投资及转换等业务。已通过泰诚财富基金销售（大连）有限公司、大泰金石基金销售有限公司购买本公司基金的投资者，当前持有基金份额的赎回业务暂不受影响。

## 二、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：肖向辉

电话：010-66295871

传真：010-66578680

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

### 三、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：黎明

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、孙睿

### 四、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、高慧丽

## 第六部分、基金的募集与合同生效

(一) 本基金根据 2014 年 4 月 29 日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准东方多策略灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2014]443 号)和《关于东方多策略灵活配置混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》(证券基金机构监管部部函[2014]151 号)的核准,并按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定进行募集。

(二) 本基金类型: 混合型

本基金存续期间: 不定期

(三) 本基金募集期为: 2014 年 5 月 12 日至 2014 年 5 月 16 日

募集份额为: 526,026,138.78 份

有效户数为: 1,564 户

(四) 本基金根据《关于东方多策略灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》(证券基金机构监管部部函[2014]288 号)的批准,于 2014 年 5 月 21 日基金合同生效。

本基金基金合同生效后,基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万元的,基金管理人应当及时报告中国证监会;连续 20 个工作日出现上述情形的,基金管理人应向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时,从其规定。

## 第七部分、基金份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

(一) 本基金管理人的直销机构为直销中心以及电子交易平台。

(二) 经本基金管理人委托,具有销售开放式基金资格的商业银行或其他机构的营业网点即其他销售机构销售网点。目前其他销售机构的名称、住所等信息请详见本招募说明书“五、相关服务机构”中“(二)其他销售机构”。本基金管理人可根据情况增减基金其他销售机构,并在基金管理人网站公示。

(三) 投资者可通过本基金直销机构或指定的其他销售机构按照规定的方式进行申购或赎回。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### (一) 开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整,但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### (二) 申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类别基金份额申购、赎回的价格。

### 三、申购与赎回的原则

(一)“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类别基金份额净值为基准进行计算；

(二)“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

(三)当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

(四)赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### 四、申购与赎回的程序

(一) 申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

(二) 申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

因投资人怠于该项查询，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构已经受理了申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询。

(三) 申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项。投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。



在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

## 五、申购和赎回的数量限制

(一) 投资者每次最低申购金额为 1.00 元（含申购费），每次定期定额最低申购金额为 1.00 元，具体办理要求以销售机构的交易细则为准，但不得低于基金管理人规定的最低限额。

(二) 基金份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 1.00 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 1.00 份的，在赎回时需一次全部赎回。

(三) 基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见更新的招募说明书。

(四) 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体请参见相关公告。

(五) 基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量或比例限制。但基金管理人必须在调整前依照有关规定在指定媒介和基金管理人网站上公告。

## 六、申购费用和赎回费用

### (一) 申购费用

本基金仅对 A 类基金份额收取申购费用，不对 C 类基金份额收取申购费用。

本基金 A 类基金份额的申购费用由申购人承担，不列入基金资产，申购费用用于本基金的市场推广、销售、登记等。投资者选择红利再投资转基金份额时不收取申购费用。

本基金的申购费率如下：

A 类基金份额		C 类基金份额
申购金额 (M)	申购费率	不收取
M < 50 万	1.20%	
50 万 ≤ M < 100 万	1.00%	
100 万 ≤ M < 500 万	0.80%	
M ≥ 500 万	1000 元/笔	

(二) 赎回费用

赎回费用由基金赎回人承担,对A类基金份额和C类基金份额同时收取,赎回费率如下:

	持有期限 (T)	赎回费率	计入基金财产比例
A 类基金份额	T < 7 天	1.50%	100%
	7 天 ≤ T < 30 天	0.75%	100%
	30 天 ≤ T < 6 个月	0.50%	75%
	6 个月 ≤ T < 1 年	0.20%	50%
	1 年 ≤ T < 2 年	0.10%	25%
	T ≥ 2 年	0%	0
C 类基金份额	T < 7 天	1.50%	100%
	7 天 ≤ T < 30 天	0.50%	
	T ≥ 30 天	0%	——

(三) 基金管理人可以根据基金合同的相关约定调整费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

(四) 基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

七、 申购份额与赎回金额的计算

(一) 基金申购份额的计算:

1、A类基金份额申购份额的计算方式

当申购费用适用比例费率时:

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} \times \text{申购费率} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日 A 类基金份额的基金份额净值}$$

当申购费用适用固定金额时:

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类基金份额的基金份额净值

例 3: 某投资者投资 100,000 元申购本基金 A 类基金份额, 对应费率为 1.20%, 假设申购当日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0622 元, 则其可得到的申购份额为:

申购费用=100,000×1.20%/(1+1.20%)=1,185.77 元

净申购金额=100,000-1,185.77=98,814.23 元

申购份额=98,814.23/1.0622=93,027.89 份

2、C 类基金份额申购份额的计算方式

申购份额=申购金额/申购当日 C 类基金份额的基金份额净值

例 4: 某投资者投资 10 万元申购本基金 C 类基金份额, 假设申购当日 C 类基金份额的基金份额净值为 1.1200 元, 则其可得到的申购份额为:

申购费用=0 元

净申购金额=100,000 元

申购份额=100,000/1.1200=89,285.71 份

上述计算中, 涉及基金份额、费用的计算结果均保留到小数点后两位, 小数点后两位以后的部分舍弃, 舍弃部分归入基金财产。

## (二) 基金赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下:

赎回费用=赎回份数×T 日 A 类/C 类基金份额净值×赎回费率

净赎回金额=赎回份数×T 日 A 类/C 类基金份额净值-赎回费用

例 5: 假定某投资者在 T 日赎回 10,000 份 A 类基金份额, 持有期限 40 天, 对应的赎回费率为 0.50%, 该日 A 类基金份额净值为 1.2500 元, 则其获得的赎回金额计算如下:

赎回费用=10,000×1.2500×0.50%=62.50 元

净赎回金额=10,000×1.2500-62.50=12,437.50 元

例 6: 假定某投资者在 T 日赎回 10,000 份 C 类基金份额, 持有期限 40 日, 对应的赎回费率为 0%, 该日 C 类基金份额净值为 1.2529 元, 则其获得的赎回金额计算如下:

赎回费用=10,000.00×1.2529×0%=0.00 元

净赎回金额=10,000.00×1.2529-0.00=12,529.00 元

上述计算中，涉及赎回费用的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分归入基金财产。

### （三）基金份额净值的计算

基金份额净值=基金资产净值总额/当日发行在外的基金份额总数

本基金 T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

## 八、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- （一）因不可抗力导致基金无法正常运作。
- （二）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- （三）证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- （四）基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- （五）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- （六）接受某一投资者申购申请后导致其持有基金份额达到或超过基金总份额 50%的。
- （七）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。
- （八）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第（一）、（二）、（三）、（五）、（七）、（八）项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

## 九、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

（一）因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

（二）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

（三）证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

（四）连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

（五）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。

（六）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第（四）项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

（一）巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

（二）巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

1、全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时，按正

常赎回程序执行。

2、部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类别基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

3、在出现巨额赎回且单个基金份额持有人当日的赎回申请超过前一开放日基金总份额20%以上的情形时，对于该基金份额持有人当日申请赎回的超过前一开放日基金总份额20%以上的基金份额，基金管理人有权全部自动进行延期办理；对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前段“1、全额赎回”或“2、部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理部分的赎回申请将被撤销。

4、暂停赎回：连续2日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

### （三）巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并按规定在指定媒介上刊登公告。

## 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

（一）发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

(二) 如发生暂停的时间为1日, 基金管理人应于重新开放日, 在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告, 并公布最近1个开放日各类基金份额的基金份额净值。

(三) 如果发生暂停的时间超过1日但少于两周, 暂停结束基金重新开放申购或赎回时, 基金管理人应按规定在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告, 并在重新开始办理申购或赎回的开放日公告最近一个开放日各类基金份额的基金份额净值。

(四) 如果发生暂停的时间超过两周, 暂停期间, 基金管理人可根据需要刊登暂停公告。暂停结束基金重新开放申购或赎回时, 基金管理人应按规定在指定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告, 并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日各类基金份额的基金份额净值。

## 十二、基金转换

为方便基金份额持有人, 本公司已在部分销售机构开通本基金和旗下各只基金的基金转换业务。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定以基金管理人对外发布的公告为准。

## 十三、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下, 接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡, 其持有的基金份额由其合法的继承人继承; 捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体; 司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料, 对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理, 并按基金登记机构规定的标准收费。

## 十四、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管, 基金销售机构可以按照规定标准收取转托管费。

## 十五、定期定额投资计划

为方便投资者或基金份额持有人，本基金已在部分销售机构开通定期定额投资业务，具体内容详见基金管理人和其他销售机构有关基金定期定额投资的公告。未来在各项技术条件和准备完备的情况下，将在其它销售渠道酌情增加本基金的定期定额投资业务。

## 十六、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。



## 第八部分、基金的投资

### 一、投资目标

在严控风险的前提下，结合灵活的资产配置和多种投资策略，充分把握市场机会，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、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指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。

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%；本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；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。

未来若法律法规或监管机构允许基金投资同业存单的，本基金在履行适当程序后，可参与同业存单的投资，具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

### 三、投资策略

本基金通过对类别资产的灵活配置，调整不同时期内基金的整体风险与收益水平，并结合多种投资策略精选具有较高投资价值的股票和债券，获得基金的长期稳定增值。

#### 1、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。

## 2、股票投资策略

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

### (1) 行业配置策略

重点行业资产配置。本基金通过对国家宏观经济运行、产业结构调整、行业自身生命周期、对国民经济发展贡献程度以及行业技术创新等影响行业中长期发展的根本性因素进行分析，从行业对上述因素变化的敏感程度和受益程度入手，筛选处于稳定的中长期发展趋势和预期进入稳定的中长期发展趋势的行业作为重点行业资产进行配置。

焦点行业资产配置。对于国家宏观经济运行过程中产生的阶段性焦点行业，本基金通过对经济运行周期、行业竞争态势以及国家产业政策调整等影响行业短期运行情况的因素进行分析和研究，筛选具有短期重点发展趋势的行业资产进行配置，并依据上述因素的短期变化对行业配置权重进行动态调整。

### (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具有连续性和延展性，这决定了公司股票价格的长期趋势。同时，在股票市场上，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。中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，而短期趋势则表现为外部因素影响短期股价偏离和恢复的过程。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。

## 3) 主题投资策略

在我国经济发展过程中，经济结构的调整和优化是一个长周期和多层次的过程，本基金通过对国内经济发展过程中的制度性、结构性或周期性趋势研究，对影响经济发展或企业盈利的关键性驱动因素及成长动因进行前瞻性的分析，挖掘市场的长期性和阶段性主题投资机会，精选出与符合投资主题的行业和具有核心竞争力的上市公司，力争获取市场超额收益，实现基金资产的长期稳定增值。

## 4) 成长投资策略

本基金也将关注成长型上市公司，重点关注中小市值股票（包括中小企业板和创业板股票）中具有潜在高成长性和稳健盈利模式的上市公司，在充分的行业研究和审慎的公司研究基础上，本基金将适度提高成长精选股票的风险水平，对优质成长型公司可给予适当估值溢价。在具体操作上，在以政策分析、行业分析和公司特质分析等基本面定性分析的基础上，采用时间序列分析和截面数据分析评价上市公司的盈利能力及其变化路径和公司盈利能力在行业内乃至整个市场所处的相对位置，评估风险，精选投资标的。

## 3、债券投资策略

### (1) 久期调整策略

本基金将根据对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，进而主动调整所持有的债券资产组合的久期值，达到增加收益或减少损失的目的。当预期市场总体利率水平降低时，本基金将延长所持有的债券组合的久期值，从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升所产生的资本利得；反之，当预期市场总体利率水平上升时，则缩短组

合久期，以避免债券价格下降带来的资本损失，获得较高的再投资收益。

### (2) 期限结构策略

在目标久期确定的基础上，本基金将通过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) 类属资产配置策略

根据资产的发行主体、风险来源、收益率水平、市场流动性等因素，本基金将市场主要细分为一般债券（含国债、央行票据、政策性金融债等）、信用债券（含公司债券、企业债券、非政策性金融债券、短期融资券、地方政府债券、资产支持证券等）、附权债券（含可转换公司债券、可分离交易公司债券、含回售及赎回选择权的债券等）三个子市场。在大类资产配置的基础上，本基金将通过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，确定类属资产的最优配置比例。

#### 1) 一般债券投资策略

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

#### 2) 信用债券投资策略

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

**回购策略：**回购放大是一种杠杆投资策略，通过质押组合中的持仓债券进行正回购，将融得资金购买债券，获取回购利率和债券利率的利差，从而提高组合收益水平。影响回购放大策略的关键因素有两个：其一是利差，即回购资金成本与债券收益率的关系，只有当债券收益率高于回购资金成本时，放大策略才能取得正的回报；其二是债券的资本利得，所持债券的净价在放大操作期间出现上涨，

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

### 3) 附权债券投资策略

本基金在综合分析可转换公司债券的债性特征、股性特征等因素的基础上，利用BS公式或二叉树定价模型等量化估值工具评定其投资价值，重视对可转换债券对应股票的分析与研究，选择那些公司和行业景气趋势回升、成长性好、安全边际较高的品种进行投资。对于含回售及赎回选择权的债券，本基金将利用债券市场收益率数据，运用期权调整利差(OAS)模型分析含赎回或回售选择权的债券的投资价值，作为此类债券投资的主要依据。

### 4、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。

## 四、投资管理流程

研究、决策、组合构建、交易、风险监控、评估和组合调整的有机配合共同构成了本基金的投资管理流程。严格的投资管理流程可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。

### 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研究方式。通过对全球宏观经济形势、中国经济发展趋势、货币政策和财政政策执行情况进行分析,深入研究行业景气状况、市场合理估值水平,预测利率变化趋势;深入研究其合理的投资价值;据此提出大类资产配置、行业配置、个股配置的投资建议。

### 2、资产配置决策

投资决策委员会依据上述研究报告,对基金的投资方向、资产配置比例等提出指导性意见。

基金经理基于研究员的投资建议,根据自己对未来一段时期内证券市场走势的基本判断,对基金资产的投资,制定月度资产配置和行业配置计划,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确定后,基金经理参考研究员的个股投资建议,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

中央交易室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。基金经理可以据以检讨投资策略，进而调整投资组合。

## 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，对投资组合进行动态调整，使之不断得到优化。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理流程进行调整。

# 五、投资限制

## (一) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1、承销证券；
- 2、违反规定向他人贷款或者提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- 5、向其基金管理人、基金托管人出资；
- 6、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 7、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

## (二) 投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- 1、本基金股票投资占基金资产的比例为0%—95%；

2、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，保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

3、本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

4、本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

5、本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

6、本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

7、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

8、本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

9、本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

10、本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

11、本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

12、本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

13、基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

14、本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

15、本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

（1）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

（2）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在



一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

(3) 本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的20%;

(4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定,即占基金资产的0%-95%;

(5) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;

16、本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过本基金资产净值的10%;

17、本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;

18、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%;因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的,本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

19、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

20、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除第2、12、18、19项外,因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在

履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

## 六、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 $\times$ 70%+中债总指数收益率 $\times$ 30%

本基金选择中债总指数收益率作为债券投资部分的业绩比较基准。中债总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。中债总指数的构成品种基本覆盖了本基金的债券投资标的,反映债券全市场的整体价格和投资回报情况。

本基金选择沪深300指数收益率作为股票投资部分的业绩比较基准。沪深300指数样本覆盖了沪深市场60%左右的市值,具有良好的市场代表性和可投资性。

若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。

## 七、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。

## 八、基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

(一)基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东及债权人权利,保护基金份额持有人的利益;

(二)不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理;

(三)有利于基金财产的安全与增值;

(四)不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## 九、基金的融资融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

## 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。

本投资组合报告所载数据截至2020年3月31日（财务数据未经审计）。

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	12,063,770.31	9.94
	其中：股票	12,063,770.31	9.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	103,112,606.70	84.98
	其中：债券	103,112,606.70	84.98
	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	304,019.62	0.25
8	其他资产	5,853,526.30	4.82
9	合计	121,333,922.93	100.00

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 （%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	535,920.00	0.44
C	制造业	1,894,552.00	1.57
D	电力、热力、燃气及水生产 和供应业	1,210,300.00	1.00
E	建筑业	956,459.00	0.79
F	批发和零售业	846,112.31	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	2,442,896.00	2.02
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	2,808,139.00	2.32
K	房地产业	1,369,392.00	1.13
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理	-	-

	业		
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,063,770.31	9.98

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	600612	老凤祥	36,700	1,470,202.00	1.22
2	600900	长江电力	70,000	1,210,300.00	1.00
3	600548	深高速	128,900	1,118,852.00	0.93
4	601318	中国平安	14,900	1,030,633.00	0.85
5	601186	中国铁建	97,300	956,459.00	0.79
6	601988	中国银行	269,000	936,120.00	0.77
7	601169	北京银行	174,200	841,386.00	0.70
8	601006	大秦铁路	122,000	829,600.00	0.69
9	600153	建发股份	108,100	826,965.00	0.68
10	000002	万科A	31,300	802,845.00	0.66

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	10,015,000.00	8.29
	其中：政策性金融债	10,015,000.00	8.29
4	企业债券	12,146,010.00	10.05
5	企业短期融资券	60,342,000.00	49.93
6	中期票据	20,333,000.00	16.82
7	可转债(可交换债)	276,596.70	0.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	103,112,606.70	85.31

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	101552026	15 晋能 MTN001	100,000	10,172,000.00	8.42
2	101562013	15 阳泉 MTN001	100,000	10,161,000.00	8.41
3	041900192	19 南京奥体	100,000	10,084,000.00	8.34

		CP001			
4	143191	17 恒信 02	100,000	10,063,000.00	8.33
5	011902092	19 国贸地产 SCP004	100,000	10,061,000.00	8.32

#### 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股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 11、投资组合报告附注

##### (1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金所持有北京银行[601169.SH]，发行人北京银行股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因业务违规受到中国银行业监督管理委员会的行政处罚。公司目前经营一切正常，上述处罚不会对正常经营造成影响。

本基金所持有中国银行[601988.SH]，发行人中国银行股份有限公司（以下简称“公司”），受到行政处罚。公司因业务违规受到中国银行业监督管理委员会、中国人民银行的行政处罚。公司目前经营一切正常，上述处罚不会对正常经营造成影响。

##### 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，由研究部负责，采用自上而下和自下而上相结合的方式。通过对全球宏观经济形势、中国经济发展趋势进行分析，深入研究国家宏观经济走势、政策走向和利率变化趋势。通过对信用利差的分析判断，可转债的投资价值分析等，深入研究各类债券合理的投

资价值。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。

本基金投资北京银行、中国银行主要基于以下原因:

公司是国内大型国有银行,业务结构稳健,PB估值便宜且股息率高,具备配置价值。

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。

## (3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,674.72
2	应收证券清算款	3,443,882.73
3	应收股利	-
4	应收利息	2,401,664.55
5	应收申购款	2,304.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,853,526.30

## (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处于转股期的可转换债券。

## (5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 第九部分、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

历史各时间段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

东方多策略灵活配置混合 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
2014.05.21-2014.12.31	10.26%	0.24%	42.55%	0.93%	-32.29%	-0.69%
2015.01.01-2015.12.31	13.95%	0.12%	6.97%	1.74%	6.98%	-1.62%
2016.01.01-2016.12.31	0.75%	0.08%	8.07%	0.98%	8.82%	0.90%
2017.01.01-2017.12.31	2.57%	0.20%	13.42%	0.45%	-10.85%	-0.25%
2018.01.01-2018.12.31	2.92%	0.15%	-16.59%	0.93%	19.51%	-0.78%
2019.01.01-2019.12.31	2.44%	0.02%	24.99%	0.86%	-22.55%	-0.84%
2020.01.01-2020.03.31	-0.91%	0.16%	-6.16%	1.34%	5.25%	-1.18%

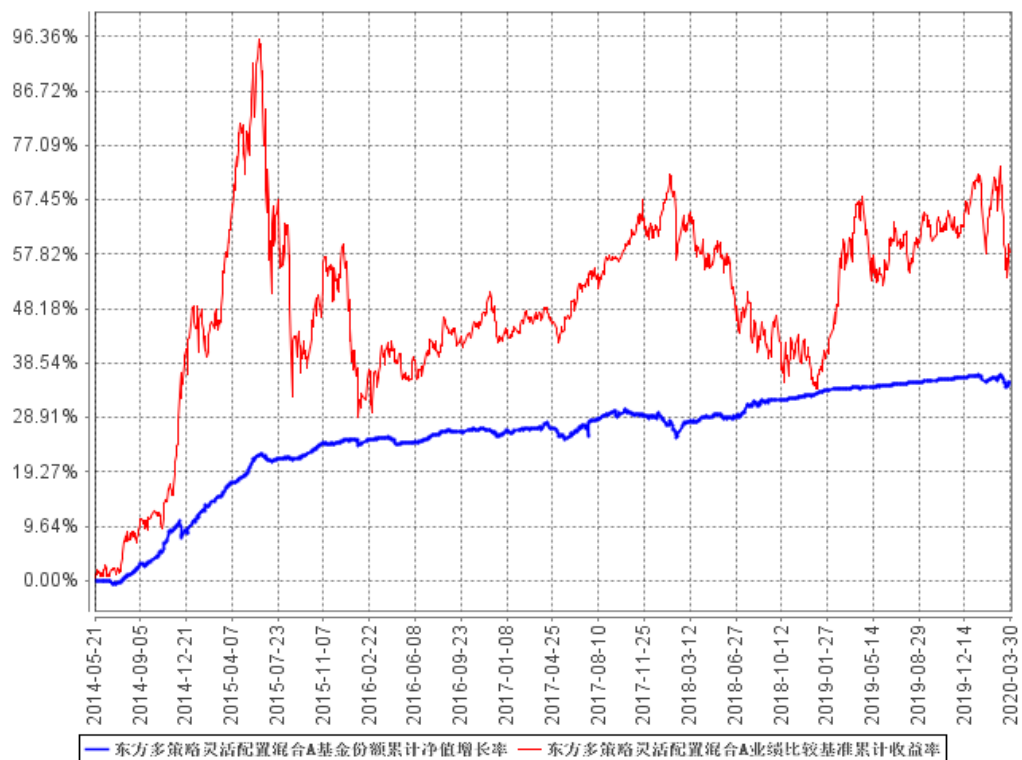
东方多策略灵活配置混合 C

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
2015.11.13-2015.12.31	0.64%	0.04%	-0.52%	1.12%	1.16%	-1.08%
2016.01.01-2016.12.31	0.22%	0.08%	-8.07%	0.98%	8.29%	-0.90%
2017.01.01-2017.12.31	55.99%	3.39%	13.42%	0.45%	42.57%	2.94%
2018.01.01-2018.12.31	2.86%	0.15%	-16.59%	0.93%	19.45%	-0.78%
2019.01.01-2019.12.31	2.21%	0.02%	24.99%	0.86%	-22.78%	-0.84%
2020.01.01-2020.03.31	-0.96%	0.17%	-6.16%	1.34%	5.20%	-1.17%

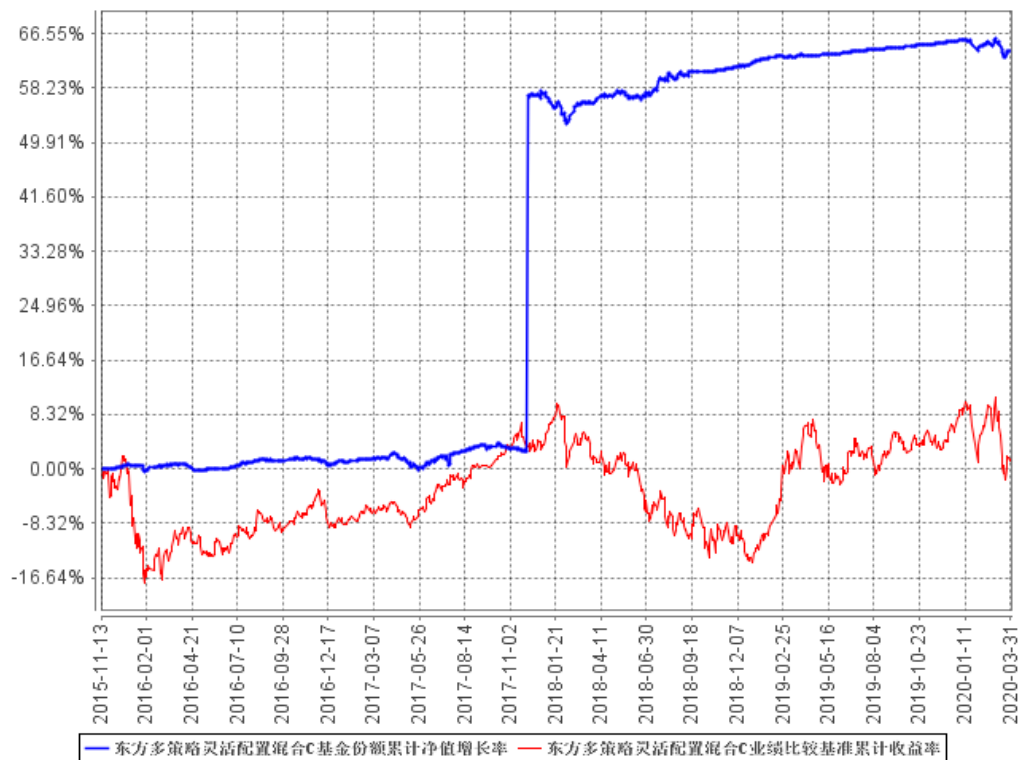
(二) 本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



东方多策略灵活配置混合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



东方多策略灵活配置混合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



## 第十部分、基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指购买各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户、期货账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。

## 第十一部分、基金资产估值

### 一、估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

### 二、估值日

本基金的估值日为相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### 三、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、股指期货合约、其它投资等资产及负债。

### 四、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券

应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、基金所持有的中小企业私募债，按成本估值。国家有最新规定的，按其规定进行估值。

6、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人

承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

## 五、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。

## 六、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### （一）估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

### （二）估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；

由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### (三) 估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### (四) 基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当

公告。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 七、暂停估值的情形

(一) 基金投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

(二) 因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

(三) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；

(四) 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 八、基金净值的确认

基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

## 九、特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所、登记结算公司发送的数据错误等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任，但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 第十二部分、基金收益与分配

### 一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### 二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 三、基金收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成相应类别的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

5、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益



分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### **五、收益分配方案的确定、公告与实施**

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2日内在指定媒介公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

### **六、基金收益分配中发生的费用**

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 第十三部分、基金的费用与税收

### 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、C类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的开户费用、账户维护费用；
- 10、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、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。

### 三、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0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费每日按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 3、C类基金份额销售服务费

本基金仅对 C 类基金份额收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费每日按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.30%年费率计提。计算方法如下：

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

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付指令，经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市场推广、持续销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

上述“一、基金费用的种类中 4—10 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。

## 四、不列入基金费用的项目

(一) 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；

(二) 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；

(三) 《基金合同》生效前的相关费用；

(四) 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。

## 五、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。

## 第十四部分、基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

(一) 基金管理人为本基金的基金会计责任方;

(二) 基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日;基金首次募集的会计年度按如下原则:如果《基金合同》生效少于2个月,可以并入下一个会计年度披露;

(三) 基金核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位;

(四) 会计制度执行国家有关会计制度;

(五) 本基金独立建账、独立核算;

(六) 基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算,按照有关规定编制基金会计报表;

(七) 基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金的年度审计

(一) 基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表及其他规定事项进行审计。

(二) 会计师事务所更换经办注册会计师时,应事先征得基金管理人同意。

(三) 基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所,须通报基金托管人。更换会计师事务所需在2日内在指定媒介公告。

## 第十五部分、基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。

### 二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点,按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息,并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会指定媒介披露,并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### 三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息,不得有下列行为:

- (一) 虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏;
- (二) 对证券投资业绩进行预测;
- (三) 违规承诺收益或者承担损失;
- (四) 诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构;
- (五) 登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性文字;
- (六) 中国证监会禁止的其他行为。

### 四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。

如同时采用外文文本的,基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的,以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括:

(一) 基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系,明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序,说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项,说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。

基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件,用于向投资者提供简明的基金概要信息。基金管理人应当依照法律法规和中国证监会的规定编制、披露与更新基金产品资料概要。

《基金合同》生效后,基金招募说明书、基金产品资料概要的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金招募说明书和基金产品资料概要,并登载在指定网站上,其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点;除重大变更事项之外,基金招募说明书、基金产品资料概要其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金招募说明书和基金产品资料概要。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金募集申请经中国证监会注册后,基金管理人在基金份额发售的3日前,将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在指定媒介上;基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

(二) 基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告,并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介和网站上。

(三) 《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定媒介和网站上登载《基金合同》生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况及基金管理人、

基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有的基金份额、承诺持有的期限等情况。

#### （四）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### （五）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起3个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起2个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《基金合同》生效不足2个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决



策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

#### (七) 临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更基金管理人的实际控制人；
- 8、基金募集期延长；
- 9、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近12个月内变更超过百分之五十；
- 11、基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近12个月内变动超过百分之三十；
- 12、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 13、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 14、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；
- 15、基金收益分配事项；

16、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

17、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

18、基金改聘会计师事务所；

19、更换基金登记机构；

20、本基金开始办理申购、赎回；

21、本基金发生巨额赎回并延期办理；

22、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

23、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

24、调整基金份额类别的设置；

25、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

26、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （八）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十）清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### （十一）中小企业私募债券的投资情况

基金管理人应在基金招募说明书的显著位置披露投资中小企业私募债券的流动性风险和信用风险，说明投资中小企业私募债券对基金总体风险的影响。本基金投资中小企业私募债券后两个交易日内，基金管理人应在中国证监会指定媒介披露所投资中小企业私募债券的名称、数量、期限、收益率等信息，并在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露中小企

业私募债券的投资情况。

#### (十二) 基金投资股指期货的信息披露

在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### (十三) 中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度,指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息,应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定,对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人进行书面或者电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊,单只基金只需选择一家报刊。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息,并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

为强化投资者保护,提升信息披露服务质量,基金管理人应当自中国证监会规定之日起,按照中国证监会规定向投资者及时提供对其投资决策有重大影响的信息。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外,也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度,在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下,自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用,该费用不得从基金财产中列支。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构,应当制作工作底稿,并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10

年。

## 七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，供社会公众查阅、复制。

## 第十六部分、风险揭示

一般来讲，预期投资收益越高，所伴随的预期风险越大。本基金属于混合型基金，其预期收益和预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金所面临的风险主要包括以下部分：

### 一、系统性风险

市场风险是指由于经济、政治、环境等因素的变化对证券价格造成的影响，其主要包括利率风险、政策风险、经济周期风险、购买力风险等。

①利率风险：对于股票投资而言，利率的变化将导致证券市场资金供求状况、上市公司的融资成本和利润水平等发生变化，同时改变市场参与者对于后市利率变化方向及幅度的预期，这将直接影响证券价格发生变化，进而影响本基金的收益水平。对于债券投资而言，利率的变化不仅会影响债券的价格及投资者对于后市的预期，而且会带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。

②政策风险：因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、产业政策、区域发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

③经济周期风险：宏观经济运行具有周期性的特点，宏观经济的运行状况将直接影响上市公司的经营、盈利情况。证券市场对宏观经济运行状况的直接反应将影响本基金的收益水平。

④购买力风险：购买力风险又称通货膨胀风险，是由于通货膨胀、货币贬值造成投资者实际收益水平下降的风险。

### 二、非系统性风险

非系统性风险是指个别行业或个别证券特有的风险，包括上市公司经营风险、信用风险等。

①经营风险：上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

②信用风险：指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券发行人出现违约、无法支付到期本息，或者由于债券发行人信用等级下降等原因造成的基金资产损失的风险。

### 三、流动性风险

流动性风险主要包括以下两个方面：一方面是指在市场或个股流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地变现或调整基金投资组合的风险。另一方面是指本基金面临大量赎回而无法及时变现其资产而造成的风险。

### 四、运作风险

①管理风险：指在基金管理运作过程中，由于基金管理人的知识、经验、判断、决策等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断而产生的风险，或者由于基金管理人内部控制不完善而导致基金财产损失的风险。

②交易风险：指在基金投资交易过程中由于各种原因造成的风险。

③运作风险：由于运营系统、网络系统、计算机或交易软件等发生技术故障等突发情况而造成的风险，或者由于操作过程中的疏忽和错误而产生的风险。

④道德风险：指业务人员道德行为违规产生的风险，包括由内幕交易、违规操作、欺诈行为等原因造成的风险；

### 五、本基金特有的风险

本基金为采用灵活配置策略的混合型基金，股票等权益类资产占基金资产的0%-95%，在资产配置上可能存在以下风险：本基金在灵活调整资产配置比例时，可能由于基金经理的预判与市场的实际表现存在较大差异，出现资产配置不合理的风险，从而对基金收益造成不利影响。

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。

## 六、法律风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

## 七、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

根据交易所就资金前端额度控制的相关要求，基金管理人（交易参与者）按照前一交易日日终的相关产品的合计资产总额作为每个交易日申报的最高额度，并与基金托管人（结算参与者）明确约定额度申报事项。由于交易所就资金前端额度控制的规定，从而可能存在影响本基金财产收益的风险。

## 第十七部分、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、基金合同的变更

(一) 变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的, 应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项, 由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告, 并报中国证监会备案。

(二) 关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行, 并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

### 二、基金合同的终止

有下列情形之一的, 基金合同应当终止:

- (一) 基金份额持有人大会决定终止的;
- (二) 基金管理人、基金托管人职责终止, 在 6 个月内没有新的基金管理人、新的基金托管人承接的;
- (三) 《基金合同》约定的其他情形;
- (四) 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

1、基金财产清算小组: 自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组, 基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成: 基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责: 基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序:

- (1) 《基金合同》终止情形出现时, 由基金财产清算小组统一接管基金;
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认;
- (3) 对基金财产进行估值和变现;



(4) 制作清算报告;

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;

(7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月。

#### **四、清算费用**

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

#### **五、基金财产清算剩余资产的分配**

依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### **六、基金财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告,基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上,并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### **七、基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 第十八部分、基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (一) 基金份额持有人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购款项、赎回费用及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

### 1、基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；
- (17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

## 2、基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大

会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利与义务

#### 1、基金托管人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保

管基金财产；

(2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户，为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

## 2、基金托管人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额

申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

(一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止《基金合同》；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或销售服务费率，但法律法规要求提高该等报酬标准或销售服务费率的除外；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (12) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费、销售服务费率；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或在不影响现有基金份额持有人利益的前提下变更收费方式；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (5) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (6) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外



的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

4、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起60日内召开。

5、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前30日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

## (三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前30日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

(1) 会议召开的时间、地点和会议形式；

- (2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式;
- (3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日;
- (4) 授权委托书证明的内容要求(包括但不限于代理人身份,代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;
- (5) 会务常设联系人姓名及联系电话;
- (6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- (7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下,由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人,还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督;如召集人为基金托管人,则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督;如召集人为基金份额持有人,则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的,不影响表决意见的计票效力。

#### (四) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规或监管机构允许的其他方式召开,会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书证明委派代表出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会,基金管理人或基金托管人不派代表列席的,不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时,可以进行基金份额持有人大会议程:

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符;

(2) 经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一)。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以

后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一（含三分之一）以上基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

4、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会。

## （五）议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### 2、议事程序

#### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

#### （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前30日公布提案，在所通知的表决截止日期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时监督员及公证机关均认为有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

#### （七）计票

##### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证, 基金管理人或基金托管人拒不出席大会的, 不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下, 计票方式为: 由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集, 则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票, 并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的, 不影响计票和表决结果。

## (八) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议, 召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自完成备案手续之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决, 在公告基金份额持有人大会决议时, 必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

(九) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定, 凡是直接引用法律法规的部分, 如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的, 基金管理人提前公告后, 可直接对本部分内容进行修改和调整, 无需召开基金份额持有人大会审议。

## 三、基金合同变更和终止的事由、程序

### (一) 《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的, 应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项, 由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告, 并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行, 并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

## (二)《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

## 四、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

## 五、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 第十九部分、基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：东方基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

法定代表人：崔伟

成立时间：2004 年 6 月 11 日

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

注册资本：叁亿元人民币

组织形式：有限责任公司

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和中国证监会许可的其他业务。

营业期限：2004 年 6 月 11 日至 2054 年 6 月 10 日

电话：(010) 66295888

传真：(010) 66295999

联系人：李景岩

#### (二) 基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号 (100032)

法定代表人：陈四清

电话：(010) 66105799

传真：(010) 66105798

联系人：赵会军

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发[1983]146 号)



存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## 二、基金管理人与基金托管人之间的业务监督、核查

### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1、基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

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、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指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。同时，经基金托管人书面确认后，纳入监督范围。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

(1) 按法律法规的规定及《基金合同》的约定, 本基金的投资资产配置比例为:

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%; 本基金持有单只中小企业私募债券, 其市值不得超过本基金资产净值的 10%; 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。

未来若法律法规或监管机构允许基金投资同业存单的, 本基金在履行适当程序后, 可参与同业存单的投资, 具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围, 并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。同时, 经基金托管人书面确认后, 纳入监督范围。

(2) 根据法律法规的规定及《基金合同》的约定, 本基金投资组合遵循以下投资限制:

- a) 本基金股票投资占基金资产的比例为 0%—95%;
- b) 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, 保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;
- c) 本基金持有一家上市公司的股票, 其市值不超过基金资产净值的 10%;
- d) 本基金管理人管理的且由本协议项下基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%;
- e) 本基金持有的全部权证, 其市值不得超过基金资产净值的 3%;
- f) 本基金管理人管理的且由本协议项下基金托管人托管的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的 10%;
- g) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;
- h) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%;
- i) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%;

j) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

k) 本基金管理人管理的且由本协议项下基金托管人托管的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

l) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

m) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

n) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

o) 本基金参与股指期货交易依据下列标准建构组合：

① 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

② 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

③ 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%；

④ 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定，即占基金资产的 0%-95%；

⑤ 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

p) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；

q) 本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部开放式基金持有一家

上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

r) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等本基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

s) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消或调整上述限制的，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，基金不受上述限制或按调整后的规定执行。

### (3) 法规允许的基金投资比例调整期限

除第 b)、l)、r)、s) 项外，由于证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

对于因法律法规变化导致本基金投资范围及投资限制调整的，基金管理人应提前通知基金托管人，经基金托管人书面同意后方可纳入投资监督范围。基金管理人知晓基金托管人投资监督职责的履行受外部数据来源或系统开发等因素影响，基金管理人应为托管人系统调整预留所需的合理必要时间。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前 2 个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和基金管理人应对措施，便于基金托管人实施交易监督。

### (4) 本基金可以按照国家的有关规定进行融资融券。

基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或提供担保；
- (3) 从事可能使基金承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资。

如法律法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制或按调整后的规定执行。

4、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

(1)基金托管人按以下方式对基金管理人参与银行间市场交易的交易对手资信风险控制措施进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金托管人在收到名单后2个工作日内回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间市场交易对手时须提前书面通知基金托管人，基金托管人于2个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，基金托管人有权报告中国证监会。

(2) 基金托管人对于基金管理人参与银行间市场交易的交易方式的控制

基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。如果基金托管人发现基金管理人没有按照事先约定的交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人与交易对手重新确定交易方式，经提醒后仍未改正时造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任。

(3) 基金管理人参与银行间市场交易的核心交易对手为中国工商银行、中国

银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，基金管理人在通知基金托管人后，可以根据当时的市场情况调整核心交易对手名单。基金管理人有责任控制交易对手的资信风险，在与核心交易对手以外的交易对手进行交易时，由于交易对手资信风险引起的损失先由基金管理人承担，其后有权要求相关责任人进行赔偿。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单，审核交易对手是否在名单内列明。

#### 5、基金托管人对基金管理人选择存款银行进行监督。

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。本基金核心存款银行名单为中国工商银行、中国银行、中国建设银行、中国农业银行和交通银行，本基金投资除核心存款银行以外的银行存款出现由于存款银行信用风险而造成的损失时，先由基金管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿。基金管理人在通知基金托管人后，可以根据当时的市场情况对于核心存款银行名单进行调整。基金托管人的监督责任仅限于根据已提供的名单，审核核心存款银行是否在名单内列明。

#### 6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

(2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

(3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

(4) 基金投资流通受限证券前,基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息,包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期,基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整,并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人,保证基金托管人有足够的时间进行审核。

(5) 基金托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定,对基金管理人是否遵守法律法规进行监督,并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的,有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明,并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则,基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的,基金托管人不承担任何责任,并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致,应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责,则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责,导致基金出现风险,基金托管人应承担连带责任。

7、基金管理人应在基金首次投资中期票据或中小企业私募债券前,与基金托管人签署相应的风险控制补充协议,并按照法律法规的规定和补充协议的约定向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资中期票据或中小企业私募债券的管理制度。

8、基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

9、基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议有关规定时,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在下一个工作日及时核对,并以书面形式向基金托管人发出回函,进行解释或举证。

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。基金托管人应当督促基金管理人赔偿因其违反《基金合同》而致使投资者遭受的损失。

对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令,基金托管人发现该投资指令违反法律法规规定或者违反《基金合同》约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并向中国证监会报告。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令,基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的,应当立即通知基金管理人,并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查,必须在规定时间内答复基金托管人并改正,就基金托管人的疑义进行解释或举证,对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

基金管理人无正当理由,拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权,或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督,情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的,基金托管人应报告中国证监会。

## (二) 基金管理人对于基金托管人的业务核查

基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户,复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时,基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正,基金托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正,并予协助配合。基金托管人对基金管理人通知的违



规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

### 三、基金财产的保管

#### （一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。
- 5、对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担责任。

#### （二）募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务协议的约定，将认购资金划入基金管理人在具有基金托管资格的商业银行开设的东方基金管理有限责任公司基金认购专户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基

金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集的属于本基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的资产托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具确认文件。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》生效的条件，由基金管理人按规定办理退款事宜。

### （三）基金的银行账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设资产托管专户，保管基金的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的资产托管专户进行。

资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

### （四）基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

### （五）债券托管账户的开立和管理

1、《基金合同》生效后，基金管理人负责以本基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表本基金进行交易；基金托管人负责以本基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管自营账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

2、基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间债券市场

回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

#### （六）其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### （七）基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应保证持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后5个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门15年以上。

### 四、基金资产净值计算与复核

#### （一）基金资产净值的计算与复核的时间和程序

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。基金份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人应每估值日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》及其他法律、法规的规定。基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日

的基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金净值信息，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金净值信息。因此，本基金的会计责任方是基金管理人，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

## 五、基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为15年。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年6月30日、每年12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年12月31日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 六、争议解决方式

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京市，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## 七、托管协议的变更与终止

### （一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会备案。

### （二）基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）《基金合同》终止；
- （2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；
- （3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；
- （4）发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

## 第二十部分、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，并将随着业务的发展和客户需求的变化，积极增加或变更服务内容，努力提高服务品质，为客户提供专业、便捷、周到的全方位服务。主要服务内容如下：

### 一、开户确认

基金管理人为投资者提供开户网上查询确认服务，投资者可通过登陆基金管理人网站了解相关的开户信息。

### 二、资料发送

#### 1、基金投资人对账单

基金管理人为基金份额持有人提供电子对账单定期发送服务，并为有需要的投资者提供纸质对账单的寄送服务。

为保证基金份额持有人获得方便、快捷、私密性较强的对账单信息，基金管理人为基金份额持有人提供电子对账单发送服务。基金份额持有人在开户后可通过基金管理人网站、客服电话、客服邮箱留下本人的电子邮件地址及相关信息，基金管理人将定期为其发送电子对账单。

#### 2、其他资料

基金管理人将根据客户的定制要求和相应的客户类别，寄送公司期刊及各类研究报告，动态地向客户提供时效性强的财经资讯。

### 三、呼叫中心服务

东方基金呼叫中心已经开通并能为客户提供安全高效的信息查询服务及人工咨询服务。客户可以通过自动语音系统进行交易信息查询、账户信息查询与修改以及基金信息的查询，在这过程中客户有任何需要帮助的地方，均可以转接人工或在语音信箱中留言；东方基金呼叫中心同时受理 E-Mail、传真等多样化咨询方式，为客户提供便捷多样的交流方式。

东方基金呼叫中心电话：010-66578578，400-628-5888（免长途通话费用）

东方基金呼叫中心传真：010-66578700

#### 四、短信服务

若投资者准确完整的预留了手机号码(小灵通用户除外),可获得免费手机短信服务,包括交易短信、短信对账单、净值短信、产品信息、基金分红提示、公司最新公告等。未预留手机号码的投资者可拨打客服电话或登陆基金管理人网站添加后获得此项服务。若因网络、数据传输等原因导致短信内容有误,具体内容以公司信息为准。

#### 五、网上交易业务

本基金已开通网上交易业务,个人投资者可通过基金管理人网上交易平台办理基金的开户、申购、赎回等各项业务,基金管理人在遵循法律法规的前提下开展网上交易申购费率优惠活动,个人投资者通过基金管理人网上交易平台办理基金申购业务时可享受申购费率优惠,详情可登陆基金管理人网站 [www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com) 查阅基金管理人旗下基金开通网上交易业务的公告。

为方便个人投资者或基金份额持有人,未来在各项技术条件和准备完备的情况下,本基金管理人将酌情丰富网上交易渠道。

#### 六、网上查询服务

通过基金管理人网站,客户还可获得如下服务:

##### 1、查询服务

所有东方开放式基金的持有人均可通过基金管理人网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

客户可以利用基金管理人网站获取基金和基金管理人的各类信息,包括基金的法律文件、业绩报告及基金管理人最新动态等各类最新资料。

#### 七、客户投诉受理服务

投资者可以通过东方基金呼叫中心(010-66578578 或 400-628-5888)、基金管理人网站([www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com))、电子邮件([services@orient-fund.com](mailto:services@orient-fund.com))、传真、信件等方式对我们的工作提出建议或意见。我们将用心倾听投资者的需求和意见,并按照《东方基金管理有限公司客户投诉

业务处理制度》流程处理，在规定的时间内予以反馈。

## 八、投资顾问服务

基金管理人拥有一支具有金融专业技能与良好沟通技能的专业的理财顾问团队，分布于北京、上海等地区，致力于为客户提供优异的个性化理财服务。



## 第二十一部分、其他应披露事项

一、在本基金存续期内，本基金管理人的内部机构设置、职能划分可能会发生变化，职能也会相应地做出调整，但不会影响本基金的投资理念、投资目标、投资范围和投资运作。

二、基金管理人和基金份额持有人应遵守《东方基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》等有关规定(包括本基金管理人对上述规则的任何修订和补充)。上述规则由本基金管理人制定，并由其解释与修改，但规则的修改若实质性地修改了基金合同，应召开基金份额持有人大会，对基金合同的修改达成决议。

三、本招募说明书将按中国证监会有关规定进行更新。招募说明书解释与基金合同不一致时，以基金合同为准。

四、从上次《招募说明书(更新)》截止日2019年5月21日，到本次《招募说明书(更新)》截止日2020年5月21日之间的信息披露事项。

公告名称	公告日期
关于增加阳光人寿保险为旗下基金销售机构并开通定投及转换业务且参与其费率优惠活动的公告	2019-5-21
关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2019-5-28
关于增加华金证券股份有限公司为东方成长收益等13只基金销售机构同时开通定期定额投资、转换业务的公告	2019-5-30
关于旗下部分基金参与上海华夏财富投资管理有限公司费率优惠活动的公告	2019-6-3
关于增加西藏东方财富证券股份有限公司为旗下基金销售机构同时开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2019-6-11
关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2019-6-18
东方基金管理有限责任公司关于旗下部分基金可参与科创板投资及相关风险揭示的公告	2019-6-21
东方基金管理有限责任公司2019年半年度最后一日基金净值公告	2019-7-1
东方多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)(2019年第1号)	2019-7-4
东方多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2019年第1号)	2019-7-4
2019年二季度报告	2019-7-18
关于旗下部分基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司费率优惠活动的公告	2019-7-25
2019年半年度报告	2019-8-27
2019年半年度报告摘要	2019-8-27
关于增加深圳前海财厚基金销售有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2019-9-4

2019年三季度报告	2019-10-23
关于增加喜鹊财富基金销售有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2019-11-14
关于增加中证金牛(北京)投资咨询有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2019-12-11
关于东方基金管理有限责任公司旗下部分基金参加上海华夏财富投资管理有限公司申购费率优惠活动的公告	2019-12-27
东方基金管理有限责任公司年度最后一日基金净值公告	2020-1-2
关于旗下部分基金继续参与交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	2020-1-2
关于旗下部分基金参与中国农业银行基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	2020-1-4
东方基金管理有限责任公司旗下全部基金2019年第4季度报告提示性公告	2020-1-17
2019年四季度报告	2020-1-17
关于增加大连网金基金销售有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2020-3-10
东方多策略灵活配置混合托管协议更新	2020-3-19
东方多策略灵活配置混合招募说明书更新	2020-3-19
东方多策略灵活配置混合招募说明书摘要更新	2020-3-19
东方多策略灵活配置混合基金合同更新	2020-3-19
东方基金管理有限责任公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同及托管协议的公告(二)	2020-3-19
东方基金管理有限责任公司关于推迟披露旗下基金2019年年度报告的公告	2020-3-27
2019年年度报告	2020-4-17
东方基金管理有限责任公司旗下全部基金2020年第1季度报告提示性公告	2020-4-22
2020年一季度报告	2020-4-22
东方基金管理有限责任公司关于暂停泰诚财富基金销售(大连)有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	2020-4-25
关于增加中信证券华南股份有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务的公告	2020-4-30
东方多策略灵活配置混合基金经理变更公告	2020-5-9
东方多策略灵活配置混合招募说明书更新	2020-5-12
东方多策略灵活配置混合招募说明书摘要更新	2020-5-12
关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2020-5-15
东方多策略灵活配置混合基金经理变更公告	2020-5-15
东方多策略灵活配置混合招募说明书更新	2020-5-16
东方多策略灵活配置混合招募说明书摘要更新	2020-5-16
关于增加和玄元保险代理有限公司为旗下基金销售机构同时开通定投及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	2020-5-16
东方基金管理有限责任公司关于延长2020年春节放假及休市时间的通知	2020-2-3

## 第二十二部分、招募说明书存放及查阅方式

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，供社会公众查阅、复制。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

投资者还可以直接登录基金管理人的网站（[www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com) 或 [www.df5888.com](http://www.df5888.com)）查阅和下载招募说明书。

## 第二十三部分、备查文件

- 一、中国证监会准予东方多策略灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- 二、《东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 三、《东方多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 四、关于申请募集注册东方多策略灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

东方基金管理有限责任公司

2020年7月