

# 东方双债添利债券型证券投资基金

## 招募说明书（更新）摘要

（2020 年第 4 号）

基金管理人：东方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

## 重要提示

东方双债添利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据2014年5月14日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准东方双债添利债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2014]486号)和《关于东方双债添利债券型证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函[2014]1137号)核准募集。本基金基金合同于2014年9月24日正式生效。

东方基金管理股份有限公司(以下简称“本基金管理人”)保证《东方双债添利债券型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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。

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

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。

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。

公司名称及基金管理人相关内容截止日为2020年8月24日,有关财务数据和净值表现截止日为2019年12月31日,本招募说明书其他所载内容截止日为2020年3月24日。

## 一、基金合同生效日期

2014年9月24日

## 二、基金管理人

### (一) 基金管理人概况

名称：东方基金管理股份有限公司

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：股份有限公司

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日至长期

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	认购股份数(万股)	持股比例
东北证券股份有限公司	19200	57.60%
河北国控资本管理有限公司	8100	24.30%
渤海国际信托股份有限公司	2700	8.10%
天津汇智长行企业管理咨询中心(有限合伙)	1170	3.51%
天津汇远长行企业管理咨询中心(有限合伙)	1123	3.37%
天津汇聚长行企业管理咨询中心(有限合伙)	1040	3.12%
合计	33333	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、电子商务部、机构业务一部、战略客户部、财富管理部、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、监察稽核部二十一个职能部门及上海分公司、北京分公司、广州分公司、成都分公司; 公司设督察长, 分管风险管理部、监察稽核部, 负责组织指导公司的风险管理和监察稽核工作。

#### (二) 基金管理人主要人员情况

##### 1、董事会成员

崔伟先生, 董事长, 经济学博士。历任中国人民银行副主任科员、主任科员、副处级秘书, 中国证监会党组秘书、秘书处副处长、处长, 中国人民银行东莞中心支行副行长、党委委员, 中国人民银行汕头中心支行行长、党委书记兼国家外汇管理局汕头中心支局局长, 中国证监会海南监管局副局长兼党委委员、局长兼党委书记, 中国证监会协调部副主任兼中国证监会投资者教育办公室召集人, 中国证券投资基金业协会第一届理事; 现任东方基金管理股份有限公司董事长, 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，吉林省总会计师协会副会长，东证融通投资管理有限公司董事长，东证融达投资有限公司董事长，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副董事长、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，燕赵都市报社经济新闻部主任，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。

## 2、监事会成员

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

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；现任东方基金管理股份有限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；现任东方基金管理股份有限公司产品开发部总经理兼运营部总经理、交易部总经理。

### 3、其他高级管理人员

崔伟先生，董事长，简历请参见董事介绍。

刘鸿鹏先生，总经理兼首席信息官，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。

张科先生，副总经理。中国人民银行研究生部金融学博士。历任甘肃银光化学工业公司中学教师，深圳发展银行蛇口支行会计、信贷业务员，深圳发展银行上海分行资金部部门负责人，平安银行北京分行副行长、资深销售总监；2019年12月加盟本公司，曾任特别助理。

杨贵宾先生，副总经理兼固定收益投资总监，投资决策委员会委员，东方双债添利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。西安交通大学经济学博士。历任富国基金管理有限责任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公司工作，任投资主办、固定收益投资总监、公司总经理助理；2019年9月加盟本公司，曾任总经理助理兼固定收益投资总监。

关洪波先生，副总经理兼市场总监，吉林大学工商管理硕士。历任吉林省松原市长山政府工作公务员，长春证券有限责任公司人事管理，新华证券有限责任公司长春安达街营业部副总经理，东北证券有限责任公司南京中山北路营业部、长春建设街营业部总经理，吉林省通化市二道江区区委常委、副区长，东北证券股份有限公司运营管理部总经理；2017年11月加盟本公司，曾任总经理助理兼



市场总监。

李景岩先生，督察长，硕士研究生，中国注册会计师。历任东北证券股份有限公司延吉证券营业部财务经理、北京管理总部财务经理。2004年6月加盟本公司，曾任财务主管，财务部经理，财务负责人，综合管理部经理兼人力资源部经理、总经理助理。

#### 4、本基金基金经理

姓名	任职日期	简历
杨贵宾 (先生)	2019年11月14日至 今	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责任公司，现任东方双债添利债券型证券投资基金基金经理，东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
许文波 (先生)	自2019年4月30日至2020年5月8日担任本基金基金经理。	
彭成军 (先生)	自2017年12月29日至2019年4月29日担任本基金基金经理。	
徐昀君 (先生)	自2014年9月24日至2017年5月12日担任本基金基金经理。	
李仆 (先生)	自2014年11月25日至2017年3月24日担任本基金基金经理。	
黄诺楠 (女士)	自2017年4月12日至2018年6月3日担任本基金基金经理。	

## 5、投资决策委员会成员

刘鸿鹏先生，总经理兼首席信息官，投资决策委员会主任委员，简历请参见董事介绍。

杨贵宾先生，公司副总经理、固定收益投资总监、投资决策委员会委员。简历请参见高级管理人员介绍。

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月加盟本公司，曾任东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任东方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、东方欣利混合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月加盟本公司，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月加盟本公司，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月加盟本公司,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。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系

### 三、基金托管人

#### (一) 基金托管人情况

##### 1、基本情况

名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）

住所：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：洪崎

成立时间：1996年2月7日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]101号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：28,365,585,227元人民币

存续期间：持续经营

电话：010-58560666

联系人：罗菲菲

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

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

了成功范例。2009年11月26日,中国民生银行在香港交易所挂牌上市。

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

民生银行荣获第十三届上市公司董事会“金圆桌”优秀董事会奖;

民生银行在华夏时报社主办的第十一届金蝉奖评选中荣获“2017年度小微金融服务银行”;

民生银行荣获《亚洲货币》杂志颁发的“2016中国地区最佳财富管理私人银行”奖项;

民生银行荣获新浪财经颁发的“年度最佳电子银行”及“年度直销银行十强”奖项;

民生银行荣获 VISA 颁发的“最佳产品设计创新奖”;

民生银行在经济观察报举办的“中国卓越金融奖”评选中荣获“年度卓越资产管理银行”;

民生银行荣获全国银行间同业拆借中心授予的“2016年度银行间本币市场优秀交易商”、“2016年度银行间本币市场优秀衍生品交易商”及“2016年度银行间本币市场优秀债券交易商”奖项;

民生银行荣获中国银行间交易协商会授予的“2016年度优秀综合做市机构”和“2016年度优秀信用债做市商”奖项;

民生银行荣获英国 WPP (全球最大的传媒集团之一)颁发的“2017年度最具价值中国品牌 100 强”;

民生银行在中国资产证券化论坛年会上被授予“2016年度特殊贡献奖”。

## 2.主要人员情况

张庆先生,中国民生银行资产托管部总经理,博士研究生,具有基金托管人高级管理人员任职资格,从事过金融租赁、证券投资、银行管理等工作,具有

26 年金融从业经历，不仅有丰富的一线实战经验，还有扎实的总部管理经验。历任中国民生银行西安分行副行长，中国民生银行沈阳分行筹备组组长、行长、党委书记。

### 3.基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于 2004 年 7 月 9 日获得基金托管资格，成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势，大力发展托管业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则，高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工 72 人，平均年龄 38 岁，100% 员工拥有大学本科以上学历，64% 以上员工具有硕士以上文凭。

中国民生银行坚持以客户需求为导向，秉承“诚信、严谨、高效、务实”的经营理念，依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台，为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。截至 2019 年 12 月 31 日，中国民生银行已托管 205 只证券投资基金。中国民生银行资产托管部于 2018 年 2 月 6 日发布了“爱托管”品牌，近百余家资管机构及合作客户的代表受邀参加了启动仪式。资产托管部始终坚持以客户为中心，致力于为客户提供全面的综合金融服务。对内大力整合行内资源，对外广泛搭建客户服务平台，向各类托管客户提供专业化、增值化的托管综合金融服务，得到各界的充分认可，也在市场上树立了良好品牌形象，成为市场上一家有特色的托管银行。自 2010 年至今，中国民生银行荣获《金融理财》杂志颁发的“最具潜力托管银行”、“最佳创新托管银行”、“金牌创新力托管银行”奖和“年度金牌托管银行”奖，荣获《21 世纪经济报道》颁发的“最佳金融服务托管银行”奖，尤其 2019 年，获得由金融时报社和国家金融与发展实验室共同评出的“年度最佳托管银行”奖项。

#### (二) 基金托管人的内部控制制度

##### 1. 内部风险控制目标

(1) 建立完整、严密、高效的风险控制体系，形成科学的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，保障资产托管业务的稳健运行和托管财

产的安全完整。

(2) 大力培育合规文化, 自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念, 严格控制合规风险, 保证资产托管业务符合国家有关法律法规和行业监管规则。

(3) 以相互制衡健全有效的风控组织结构为保障, 以完善健全的制度为基础, 以落实到位的过程控制为着眼点, 以先进的信息技术手段为依托, 建立全面、系统、动态、主动、有利于差错防弊、堵塞漏洞、消除隐患、保证业务稳健运行的风险控制制度, 确保托管业务信息真实、准确、完整、及时。

## 2. 内部风险控制组织结构

总行高级管理层负责部署全行的风险管理工作。总行风险管理委员会是总行高级管理层下设的风险管理专业委员会, 对高级管理层负责, 支持高级管理层履行职责。资产托管业务风险控制工作在总行风险管理委员会的统一部署和指导下开展。

3. 总行各部门紧密配合, 共同把控资产托管业务运行中的风险, 具体职责与分工如下: 总行风险管理部作为总行风险管理委员会秘书机构, 是全行风险管理的统筹部门, 对资产托管部的风险控制工作进行指导; 总行法律事务部负责资产托管业务项下的相关合同、协议等文本的审定; 总行内控合规部负责该业务与管理的合规性审查、检查与督导整改; 总行审计部对全行托管业务进行内部审计。包括定期内部审计、现场和非现场检查等; 总行办公室与资产托管部共同制定声誉风险应对预案。按资产托管部需求对由托管业务引发的声誉风险事件进行定向舆情监测, 对由托管业务引起的声誉风险进行应急处置, 包括与全国性媒体进行沟通、避免负面报道、组织正面回应等。

### 内部风险控制原则:

(1) 合法合规原则。风险控制应符合和体现国家法律、法规、规章和各项政策。

(2) 全面性原则。风险控制覆盖托管部的各个业务中心、各个岗位和各级人员, 并涵盖资产托管业务各环节。

(3) 有效性原则。资产托管业务从业人员应全力维护内部控制制度的有效

执行,任何人都没有超越制度约束的权力。

(4) 预防性原则。必须树立“预防为主”的管理理念,控制资产托管业务中风险发生的源头,防患于未然,尽量避免业务操作中各种问题的产生。

(5) 及时性原则。资产托管业务风险控制制度的制定应当具有前瞻性,并且随着托管部经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变进行及时的修改或完善。发现问题,要及时处理,堵塞漏洞。

(6) 独立性原则。各业务中心、各岗位职能上保持相对独立性。风险监督中心是资产托管部下设的执行机构,不受其他业务中心和个人干涉。业务操作人员和检查人员严格分开,以保证风险控制机构的工作不受干扰。

(7) 相互制约原则。各业务中心、各岗位权责明确,相互牵制,通过切实可行的相互制衡措施来消除风险控制的盲点。

(8) 防火墙原则。托管银行自身财务与托管资产财务严格分开;托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门隔离。

#### 4、内部风险控制制度和措施

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

(2) 建立健全的组织管理结构:前后台分离,不同部门、岗位相互牵制。

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

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

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

(6) 应急预案:制定完备的《应急预案》,并组织员工定期演练;建立异地灾备中心,保证业务不中断。

#### 5、资产托管部内部风险控制

中国民生银行股份有限公司从控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、



监控等五个方面构建了托管业务风险控制体系。

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

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

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

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

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

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

(三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规的规定,对基金的

投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

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

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

## 四、相关服务机构

### (一) 直销机构

#### 1、柜台交易

名称: 东方基金管理股份有限公司直销中心

住所: 北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

法定代表人: 崔伟

办公地址: 北京市西城区锦什坊街 28 号 3 层

联系人: 史鹏浩

电话: 010-66295921

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)

2、兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路154号

办公地址：上海市江宁路168号兴业大厦9楼

法定代表人：陶以平

联系人：刘玲

电话：021-52629999

传真：021-62569070

客服电话：95561

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

3、中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：李庆萍

客服电话：95558

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

4、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：张学文

联系人：王硕

传真：010-68858057

客服电话：95580

网址: [www.psb.com](http://www.psb.com)

5、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)

6、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)

7、青岛银行股份有限公司

住所: 青岛市崂山区秦岭路 6 号 3 号楼

办公地址: 青岛市崂山区秦岭路 6 号 3 号楼

法定代表人: 郭少泉

联系人: 陈界交

电话: 0532-68629956

传真: 0532-68629939

客户服务电话: 96588(青岛); 400-66-96588(全国)

网址: <http://www.qdccb.com>

8、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)

#### 9、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)

#### 10、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)

#### 11、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)

12、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](http://www.ebscn.com)

13、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](http://www.gtja.com)

14、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](http://www.htsec.com)

#### 15、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)

#### 16、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)

#### 17、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)

18、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](http://www.lxsec.com)

19、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](http://www.zts.com.cn)

20、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](http://www.962518.com)

#### 21、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](http://www.i618.com.cn)

#### 22、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](http://www.swhysc.com)

#### 23、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](http://www.hysec.com)

#### 24、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)

#### 25、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)

#### 26、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)

27、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)

28、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)

29、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)

30、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)

31、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](http://www.cs.ecitic.com)

32、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](http://www.citicsf.com)

### 33、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](http://www.cicc.com.cn)

### 34、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](http://stock.pingan.com)

### 35、东兴证券股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层

办公地址: 北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层

法定代表人: 魏庆华

联系人: 夏锐

电话: 010-66559079

传真: 010-66555147

客服电话: 95309

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

36、国金证券股份有限公司

住所: 四川省成都市东城根上街95号

办公地址: 四川省成都市东城根上街95号

法定代表人: 冉云

联系人: 刘婧漪

电话: 028-86690057

传真: 028-86690126

客服电话: 95310

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

37、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)

38、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>

39、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.msq.com

#### 40、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/>

#### 41、中国中金财富证券有限公司

住所:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

法定代表人:高涛

客户服务热线:95532、400-600-8008

网站: [www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

#### 42、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)

43、上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所: 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址: 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人: 张跃伟

联系人: 单丙焜

电话: 021-20691832

传真: 021-20691861

客户服务电话: 400 820 2899

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

44、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)

45、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)

46、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

47、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

48、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

49、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

50、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

51、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

52、浙江同花顺基金销售有限公司

住所: 杭州市文二西路1号903室

办公地址: 浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人: 凌顺平

联系人: 刘晓倩

联系电话: 0571-88911818

传真: 0571-88910240

客服电话: 4008-773-772

网址: [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

53、北京增财基金销售有限公司

住所: 北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号

办公地址: 北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号

法定代表人: 罗细安

联系人: 史丽丽

电话: 010-67000988

传真: 010-67000988

客户服务电话: 400-001-8811

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

54、上海利得基金销售有限公司

住所: 上海宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址: 上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人: 李兴春

联系人: 赵沛然

电话: 021-50583533

传真: 021-50583633

客服电话: 400-921-7755

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

55、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

56、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

57、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

58、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

59、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

60、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

61、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

62、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)

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(入住深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址: 深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人: TEO WEE HOWE

联系人: 叶健

电话: 0755-89460507

传真: 0755-21674453

客户服务电话: 400-684-0500

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

81、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龙园3号

办公地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中龙园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)

82、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](http://danjuanapp.com)

83、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

84、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

网站：www.snjijin.com

85、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

网站：www.18.cn

86、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

网站：www.huilinbd.com

## 87、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

网站：[www.caiho.cn](http://www.caiho.cn)

## 88、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

电话：18600730680

客服电话：400-6997-719

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

## 89、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

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

(三) 登记机构

名称：东方基金管理股份有限公司

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 或 www.df5888.com

(四) 出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所

住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:俞卫锋

联系人:孙睿

电话:021-31358666

传真:021-31358600

经办律师:黎明、孙睿

(五) 审计基金财产的会计师事务所

名称:立信会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市南京东路61号4楼

办公地址:北京市海淀区西四环中路16号院7号楼10层

法定代表人:朱建弟

联系人:朱锦梅

电话:010-68286868

传真:010-88210608

经办注册会计师:朱锦梅、高慧丽

## 五、基金名称和基金类型

(一) 本基金名称:东方双债添利债券型证券投资基金

(二) 本基金类型:债券型基金

(三) 基金运作方式: 契约型、开放式

## 六、基金的投资目标和投资范围

(一) 基金的投资目标

在适度承担信用风险并保持基金资产流动性的条件下,对固定收益类资产进行积极主动的投资管理,在此基础上通过个股精选配置权益类资产,实现基金资产长期、稳定的投资回报。

(二) 基金的投资方向

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债券、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)、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金主要投资于国债、地方政府债、中央银行票据、政策性金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、商业银行金融债与次级债、中小企业私募债券、资产支持证券、可转换债券(含分离交易的可转换债券)、债券回购、银行存款等固定收益类资产。本基金所指的信用债券是指企业债、公司债、中期票据、短期融资券、商业银行金融债与次级债、中小企业私募债券、资产支持证券等除国债和央行票据之外的、非国家信用的债券类品种。

本基金还可投资于股票和权证等权益类资产。

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:债券资产占基金资产的比例不低于80%,其中投资于信用债券和可转换债券的资产不低于非现金资产的80%;股票等权益类资产占基金资产的比例不超过20%,权证投资比例不超过基金资产净值的3%;现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

当法律法规的相关规定变更时,基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。



## 七、基金的投资策略

### (一) 大类资产配置策略

本基金主要投资于债券市场,在严控投资风险的基础上,通过投资于股票市场提高投资收益。本基金紧密跟踪债券市场与股票市场的运行情况和风险收益特征,结合对宏观经济环境、国家政策趋向及利率变化趋势等重点分析,判断债券市场和股票市场的相对投资价值,在债券资产与股票资产之间进行动态调整。

### (二) 固定收益类资产投资策略

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,本基金将债券市场主要细分为一般债券(含国债、中央银行票据、政策性金融债等)、信用债券(公司债、企业债、金融债(不含政策性金融债)、资产支持证券、短期融资券、中小企业私募债券、中期票据等)、附权债券(含可转换债券、分离交易可转换债券、含回售及赎回选择权的债券等)三个子市场。通过深入研究宏观经济发展状况,预测价格和利率变化趋势,在债券组合久期调整及期限结构配置基础上,采取积极的投资策略,确定类属资产的最优配置比例。

#### 1、信用债券投资策略

信用债券的信用利差与债券发行人所在行业特征和自身情况密切相关。本基金将通过行业分析、公司资产负债分析、公司现金流分析、公司运营管理分析和公司发展前景分析等细致的调查研究,分析信用债券的违约风险及合理的信用利差水平,对信用债券进行独立、客观的价值评估。

#### 2、可转换债券投资策略

本基金在分析宏观经济运行特征和证券市场趋势判断的前提下,在综合分析可转换债券的债性特征、股性特征等因素的基础上,选择其中安全边际较高、股性活跃并具有较高上涨潜力的品种进行投资。结合行业分析和个券选择,对成长前景较好的行业和上市公司的可转换债券进行重点关注,选择投资价值较高的个券进行投资。

#### 3、中小企业私募债券投资策略

本基金对中小企业私募债投资,主要通过期限和品种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。

#### 4、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。

### (三) 权益类资产投资策略

本基金为债券型基金, 主要投资于固定收益类资产, 权益类资产作为本基金增强收益的手段, 将在风险控制的基础上谋求资产增值。

#### 1、股票投资策略

本基金可适当投资于股票, 增强基金资产收益。本基金股票投资部分将重点投资于成长性好、估值水平具有一定安全边际的股票, 同时参考公司的历史分红情况和分红能力。本基金将全面考察公司所处行业的产业竞争格局、业务发展模式、盈利增长模式、公司治理结构等基本面特征等对公司的投资价值进行分析和比较, 挖掘具备投资价值的股票。

#### 2、权证投资策略

本基金管理人将以价值分析为基础, 在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上, 充分考量可能持有的权证品种的收益率、流动性及风险收益特征, 在风险可控的基础上, 追求较高风险调整后收益。

### (四) 其他金融工具的投资策略

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他衍生金融工具, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要

以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。本基金将在有效风险管理的前提下,通过对标的品种的基本面研究,结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险对冲比例,谨慎投资。

## 八、基金的业绩比较基准

本基金采用“中债综合全价指数收益率 $\times$ 80%+沪深300指数收益率 $\times$ 20%”作为投资业绩比较基准。

本基金选择中债综合全价指数收益率作为债券投资部分的业绩比较基准。中债综合全价指数样本具有广泛的市场代表性,涵盖主要交易市场(银行间市场、交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期等),是中国目前最权威,应用也最广的指数。中债综合全价指数的构成品种基本覆盖了本基金的债券投资标的,反映债券全市场的整体价格和投资回报情况。

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。

## 九、基金的风险收益特征

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

## 十、投资组合报告

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

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

本投资组合报告所载数据截至2019年12月31日。

(一) 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	69,732,589.74	14.24
	其中:股票	69,732,589.74	14.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	384,162,401.33	78.45
	其中:债券	384,162,401.33	78.45
	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	7,000,000.00	1.43
	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	24,259,008.76	4.95
8	其他各项资产	4,558,831.76	0.93
9	合计	489,712,831.59	100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,168,700.00	0.28
C	制造业	46,628,530.54	11.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,652,200.00	0.64
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,205,500.00	0.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,865,180.00	0.69
J	金融业	5,442,060.00	1.31
K	房地产业	4,154,400.00	1.00

L	租赁和商务服务业	4,460,399.20	1.08
M	科学研究和技术服务业	745,500.00	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	410,120.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	69,732,589.74	16.84

(三)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资

明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600585	海螺水泥	60,000	3,288,000.00	0.79
2	600887	伊利股份	99,911	3,091,246.34	0.75
3	601318	中国平安	36,000	3,076,560.00	0.74
4	000651	格力电器	40,000	2,623,200.00	0.63
5	300760	迈瑞医疗	14,000	2,546,600.00	0.61
6	002027	分众传媒	399,920	2,503,499.20	0.60
7	300059	东方财富	150,000	2,365,500.00	0.57
8	600031	三一重工	130,000	2,216,500.00	0.54
9	600048	保利地产	130,000	2,103,400.00	0.51
10	600570	恒生电子	26,000	2,020,980.00	0.49

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	21,035,500.00	5.08
	其中:政策性金融债	21,035,500.00	5.08
4	企业债券	191,935,599.30	46.34
5	企业短期融资券	20,100,000.00	4.85
6	中期票据	10,164,000.00	2.45
7	可转债(可交换债)	140,927,302.03	34.03

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	384,162,401.33	92.75

(五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资  
 明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例(%)
1	110059	浦发转债	240,000	26,217,600.00	6.33
2	143734	18金隅02	240,000	25,036,800.00	6.04
3	1280455	12桂交投 债	200,000	21,310,000.00	5.15
4	155229	19阳煤01	200,000	20,314,000.00	4.90
5	155296	19西南01	200,000	20,136,000.00	4.86

(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持  
 证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投  
 资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

(八)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资  
 明细

本基金本报告期末未持有权证。

(九)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

(十)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

本基金所持有的三一重工(600031.SH)于2019年12月13日公告,其公司高  
 管李京京被上海证券交易所通报批评。主要违法违规事实:违反了《公司法》关  
 于高级管理人员在任职期间每年转让股份不得超过其所持有公司股份总数 25%  
 的相关规定。对于超额减持部分,李京京未按照规定在减持的 15 个交易日前披

露减持计划。

本基金所持有的格力电器(000651)于2019年2月1日公告,公司被中国证券监督管理委员会广东监管局出具警示函的行政监管措施,主要内容为“经查,你作为珠海格力电器股份有限公司(以下简称格力电器)董事长,在2019年1月16日下午召开的格力电器2019年第一次临时股东大会上发布了格力电器2018年营业收入和净利润等有关业绩信息,而格力电器在股东大会结束后的当天晚间才发布2018年度业绩预告。”

本基金所持有的保利地产(600048.SH)于2019年6月1日公告,公司副总经理吴章焰被广元市监察委员会立案调查并采取留置措施。目前,公司已对相关工作进行了妥善安排,公司生产经营情况正常。

本基金所持有浦发转债(110059.SH),发行人上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“公司”),受到行政处罚。于2019年1月至2019年12月期间,因分行业务违规受到银保监会的行政处罚。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。

本基金投资上述公司主要基于以下原因:

基于基本面进行选股,选择盈利增速较高、基本面向好、估值较低等符合选股标准的股票进行分散投资。

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、报告期末其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	64,167.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,490,251.65
5	应收申购款	4,413.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-



8	其他	-
9	合计	4,558,831.76

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110053	苏银转债	11,739,000.00	2.83
2	113026	核能转债	6,815,340.00	1.65
3	110043	无锡转债	6,637,800.00	1.60
4	113014	林洋转债	5,794,620.00	1.40
5	113024	核建转债	5,159,430.00	1.25
6	113511	千禾转债	5,148,327.60	1.24
7	128013	洪涛转债	3,854,800.00	0.93
8	113021	中信转债	3,394,200.00	0.82
9	128051	光华转债	3,371,100.00	0.81
10	128034	江银转债	3,156,172.80	0.76
11	110045	海澜转债	3,046,200.00	0.74
12	127006	敖东转债	2,976,480.00	0.72
13	113516	苏农转债	2,806,845.30	0.68
14	123011	德尔转债	2,742,300.00	0.66
15	128064	司尔转债	2,094,767.29	0.51
16	110058	永鼎转债	1,457,960.00	0.35
17	110041	蒙电转债	1,410,480.00	0.34
18	127012	招路转债	1,260,490.00	0.30
19	128049	华源转债	902,236.00	0.22
20	123019	中来转债	702,060.00	0.17
21	113534	鼎胜转债	660,720.00	0.16
22	113508	新风转债	602,530.40	0.15
23	127013	创维转债	591,350.00	0.14
24	128048	张行转债	584,500.00	0.14
25	113027	华钰转债	538,850.00	0.13
26	128054	中宠转债	502,080.00	0.12
27	128057	博彦转债	472,320.00	0.11
28	123023	迪森转债	456,139.70	0.11
29	113530	大丰转债	451,760.00	0.11
30	128022	众信转债	419,800.00	0.10
31	113535	大业转债	401,400.00	0.10
32	123018	溢利转债	363,540.00	0.09
33	110055	伊力转债	341,640.00	0.08
34	128037	岩土转债	335,930.00	0.08

35	128025	特一转债	334,830.00	0.08
36	123026	中环转债	327,120.00	0.08
37	128044	岭南转债	318,827.95	0.08
38	113012	骆驼转债	315,990.00	0.08
39	128056	今飞转债	301,320.00	0.07
40	127004	模塑转债	284,970.00	0.07
41	128023	亚太转债	281,970.00	0.07
42	128026	众兴转债	278,970.00	0.07
43	113527	维格转债	275,760.00	0.07
44	128062	亚药转债	268,410.00	0.06
45	123028	清水转债	259,575.00	0.06
46	110051	中天转债	222,460.00	0.05
47	113536	三星转债	219,440.00	0.05
48	113525	台华转债	216,960.00	0.05
49	123004	铁汉转债	201,940.00	0.05
50	113025	明泰转债	194,493.60	0.05
51	128066	亚泰转债	169,755.00	0.04
52	127011	中鼎转 2	112,870.00	0.03
53	128065	雅化转债	109,770.00	0.03

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## 十一、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### (一) 基金的净值表现

本报告期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

#### 东方双债添利债券 A 类

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

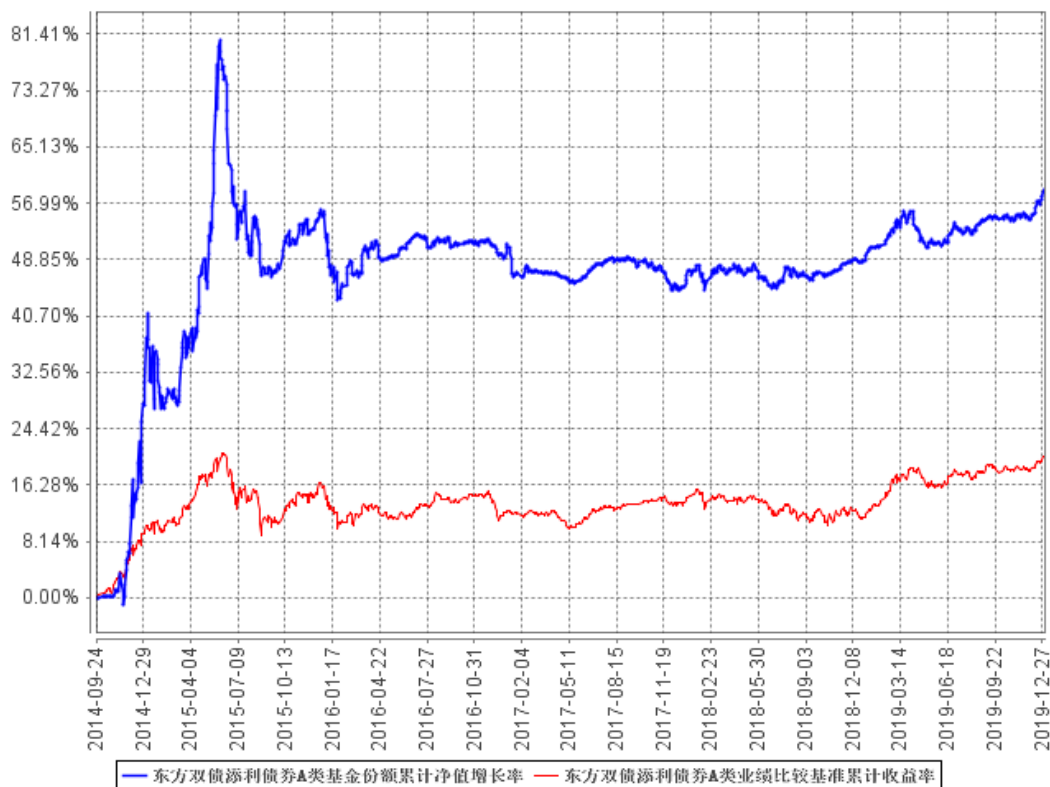
2014.09.24-2014.12.31	31.09%	1.42%	9.73%	0.35%	21.36%	1.07%
2015.01.01-2015.12.31	18.32%	1.22%	5.75%	0.50%	12.57%	0.72%
2016.01.01-2016.12.31	-3.79%	0.37%	-3.27%	0.30%	-0.52%	0.07%
2017.01.01-2017.12.31	-2.86%	0.18%	1.27%	0.14%	-4.13%	0.04%
2018.01.01-2018.12.31	2.54%	0.21%	-1.72%	0.26%	4.26%	-0.05%
2019.01.01-2019.12.31	7.12%	0.20%	7.80%	0.24%	-0.68%	-0.04%

东方双债添利债券C类

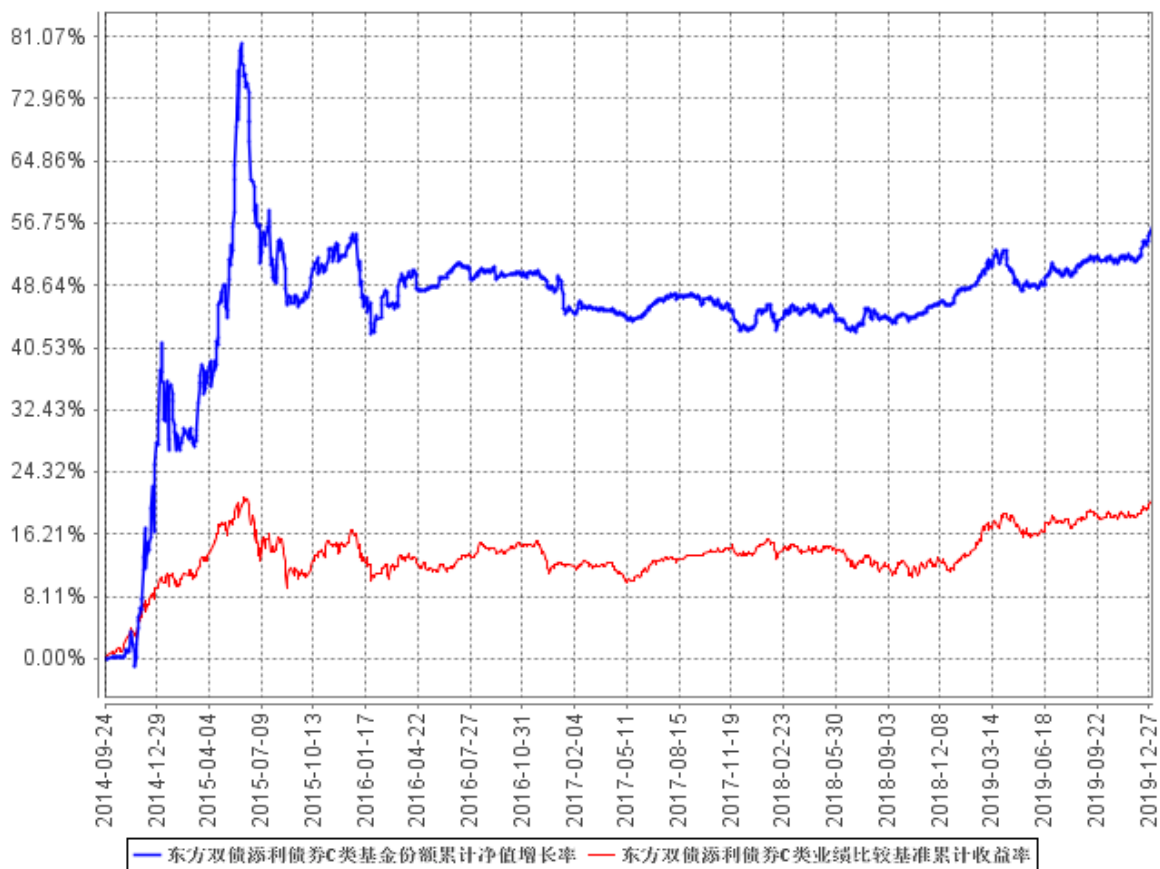
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2014.09.24-2014.12.31	31.04%	1.42%	9.73%	0.35%	21.31%	1.07%
2015.01.01-2015.12.31	17.80%	1.22%	5.75%	0.50%	12.05%	0.72%
2016.01.01-2016.12.31	-4.17%	0.37%	-3.27%	0.30%	-0.90%	0.07%
2017.01.01-2017.12.31	-3.21%	0.18%	1.27%	0.14%	-4.48%	0.04%
2018.01.01-2018.12.31	2.13%	0.21%	-1.72%	0.26%	3.85%	-0.05%
2019.01.01-2019.12.31	6.79%	0.20%	7.80%	0.24%	-1.01%	-0.04%

(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

东方双债添利债券A类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



东方双债添利债券C类基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## 十二、费用概览

### (一) 管理费率：

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70%年费率计提。

### (二) 托管费率：

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。

### (三) C类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40%年费率计提。

## 十三、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》《证券投资基金销售

管理办法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》《东方双债添利债券型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的要求,结合本基金运作的实际情况,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要内容如下:

(一) 本公司改制为股份有限公司,名称变更为“东方基金管理股份有限公司”。

(二) 在“第三部分 基金管理人”部分,对相关内容进行了更新。

上述内容仅为本基金更新招募说明书的摘要,详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书详细内容,可登录东方基金管理股份有限公司网站 [www.orient-fund.com](http://www.orient-fund.com)。

东方基金管理股份有限公司

2020年8月