

东方精选混合型开放式证券投资基金
招募说明书（更新）
（2011 年第 1 号）

基金管理人：东方基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

日 期：二〇一一年八月

重要提示

东方精选混合型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2005 年 9 月 7 日中国证券监督管理委员会《关于同意东方精选混合型开放式证券投资基金募集的批复》（证监基金字【2005】153 号）和《关于东方精选混合型开放式证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函【2005】273 号）的核准，进行募集。本基金基金合同于 2006 年 1 月 11 日正式生效。本基金为混合型开放式。

东方基金管理有限责任公司（以下简称“本基金管理人”、“管理人”或“本公司”）保证《东方精选混合型开放式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》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金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，并对认购（或申购）本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险和本基金所投资的股票、债券、衍生品等各种投资工具的相关风险等。在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 6 月 30 日（财务数据未经审计），如无其他特别说明，本招募说明书其他所载内容截止日为 2011 年 7 月 11 日。

目 录

一 绪 言	1
二 释 义	1
三 基金管理人	5
四 基金托管人	14
五 相关服务机构	20
六 基金的募集与基金合同的生效	32
七 基金份额的申购与赎回	32
八 基金的投资	39
九 基金的业绩	44
十 基金的财产	49
十一 基金资产的估值	49
十二 基金的收益与分配	55
十三 基金的费用与税收	56
十四 基金的会计与审计	60
十五 基金的信息披露	60
十六 风险揭示	65
十七 基金的终止与清算	62
十八 基金合同的内容摘要	68
十九 基金托管协议的内容摘要	76
二十 对基金份额持有人的服务	80
二十一 其他应披露事项	77
二十二 招募说明书存放及查阅方式	84
二十三 备查文件	84

一 绪 言

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》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、其他有关规定及《东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”或“基金合同”)编写。

本《招募说明书》阐述了东方精选混合型开放式证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的必要事项,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本《招募说明书》。

本基金管理人承诺本《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》作出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证监会核准。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本基金合同的当事人,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《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。

二 释 义

在《东方精选混合型开放式证券投资基金招募说明书》中,除非文义另有所指,下列词语具有如下含义:

基金或本基金:	指东方精选混合型开放式证券投资基金
基金合同或本基金合同:	指《东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
招募说明书或本招募说明书:	指《东方精选混合型开放式证券投资基金招募说明书》,招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行

	说明的法律文件,自基金合同生效之日起,每6个月更新1次,并于每6个月结束之日后的45日内公告,更新内容截至每6个月的最后1日
基金份额发售公告:	指《东方精选混合型开放式证券投资基金基金份额发售公告》
托管协议或本托管协议:	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《东方精选混合型开放式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
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
《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,自2004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作出的修订
《运作办法》:	指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》
《销售办法》:	指中国证监会2004年6月25日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》
《信息披露办法》:	指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》
法律法规:	指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、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
中国证监会:	指中国证券监督管理委员会
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
基金管理人或本基金管理人:	指东方基金管理有限责任公司
基金托管人或本基金托管人:	指中国民生银行股份有限公司
注册登记业务:	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、基金份额注册登记、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等
注册登记机构:	指办理注册登记业务的机构。基金的注册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注册登记业务的机构
投资人:	指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的合称
个人投资者:	指年满 18 周岁, 合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证件等有效身份证件的中国公民, 以及中国证监会批准的其他可以投资基金的自然人
机构投资者:	指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册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
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》规定的条件, 经中国证监会批准投资于中国证券市场, 并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
元:	指人民币元
基金募集期:	指自基金份额发售之日起到基金认购截止日的时间段, 最长不超过 3 个月
基金合同生效日:	指基金募集期结束后达到成立条件, 基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕, 并收到其书面确认的日期
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, 按照基金合同规定的程序终止基金合同的日期
存续期:	指基金合同生效至终止之间的不定期期限
工作日:	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日

认购:	指在基金募集期间, 投资人申请购买基金份额的行为
申购:	指在基金存续期内, 投资人申请购买基金份额的行为
赎回:	指基金份额持有人按基金合同规定的条件要求基金管理人购回基金份额的行为
巨额赎回:	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)超过上一日基金总份额的 10%时
基金转换:	指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效的业务规则在本基金份额与基金管理人管理的其他基金份额间的转换行为
转托管:	指基金份额持有人在同一基金的不同销售机构之间实施的所持基金份额销售机构变更的操作
定期定额投资计划:	指投资者通过有关销售机构提出申请, 约定每期扣款日、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者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式
直销机构:	指东方基金管理有限责任公司
代销机构:	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件, 取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议, 代为办理基金销售业务的机构
销售机构:	指直销机构和代销机构
基金销售网点:	指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点
基金账户:	指注册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
开放日:	指基金管理人办理基金份额申购、赎回或其他业务的日期
T 日:	指销售机构确认的投资人有效申请工作日
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、证券持有期间产生的公允价值变动及因运用基金财产带来的成本和费用的节约
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
基金资产净值:	指基金资产总值减去基金负债后的价值
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
指定媒体:	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体
不可抗力:	指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的,使本基金合同当事人无法全部履行或无法部分履行本基金合同的任何事件,包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

三 基金管理人

(一) 基金管理人概况

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: 杨树财

总经理: 单宇

成立日期: 2004 年 6 月 11 日

注册资本: 壹亿元人民币

经营范围: 基金募集; 基金销售; 资产管理; 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

基金管理公司法人许可证编号: A039

企业法人营业执照注册号: 110000007042263

联系人: 吕日

电话: 010-66295888

股权结构

持股单位	出资金额(人民币)	占总股本比例
东北证券股份有限公司	4600 万元	46%
上海城投控股股份有限公司	1800 万元	18%
中辉国华实业(集团)有限公司	1800 万元	18%
河北省国有资产控股运营有限公司	1800 万元	18%
合 计	10,000 万元	100%

内部组织结构:

股东会是公司的最高权力机构, 下设董事会和监事会。董事会下设合规与风险控制委员会; 本公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制, 下设总经理办公会、风险控制委员会、投资决策委员会和研究部、基金管理部、交易部、市场部、专户管理部、信息技术部、登记清算部、金融工程部、监察稽核部、人力资源部、综合管理部、财务部十二个职能部门和上海分公司; 本公司设督察长, 领导监察稽核部, 负责公司的监察稽核工作。

(二) 基金管理人主要人员情况

1. 董事会成员

杨树财先生, 董事长(2011年2月28日经中国证券监督管理委员会证监许可【2011】292号文核准), 硕士研究生, 中国注册会计师, 高级会计师。吉林省高级职称评委会委员, 中国证券业协会财务会计委员会执行委员。历任广西北海吉兴会计师事务所主任会计师, 吉林会计师事务所副所长, 东北证券有限责任公司财务总监、副总裁兼财务总监, 现任东北证券股份有限公司总裁、副董事长。

安红军先生, 董事, 经济学博士。历任南方证券投资银行总部上海业务处处长、南方证券上海分公司总经理助理、南方证券投资银行总部副总经理、总经理, 天同证券总裁助理, 华泰证券有限公司投资银行业务总监, 上海世博土地控股有限责任公司业务总监, 上海市原水股份有限公司总经理, 上海城投控股股份有限公司总经理; 现任上海城投控股股份有限公司总裁。

齐伟丽女士，董事，会计师。历任中国计算机软件与技术服务总公司工程师，中软总公司多维公司会计师，北京宏世通达商贸集团财务部长，中辉投资有限公司财务总监，新疆中建投资有限责任公司总经理，中天高科特种车辆有限公司副总经理，北京中辉阳光房地产开发有限公司董事；现任北京京发置业有限公司监事，北京宏世通达商贸集团副总经理。

邱建武先生，董事，高级工程师。历任廊坊市轴瓦厂团支部书记，河北省粮油工业公司总经理、党支部书记，河北省粮油集团公司副总裁、党委常委，河北省粮食局副局长、党组成员，河北省商贸集团公司党委书记、董事长，河北省工贸资产经营有限公司党委书记、董事长、总裁；现任河北省国有资产控股运营有限公司党委书记、董事长。

张兴志先生，董事，硕士研究生，研究员。历任吉林省经济体制改革委员会职员、研究所所长、宏观处处长、产业处处长，吉林亚泰集团股份有限公司副总裁；现任东北证券股份有限公司副总裁、纪委书记。

单宇先生，董事，大学本科。15年以上证券及基金从业经历，历任吉林省信托投资公司证券管理总部证券投资管理部经理，吉林省宝路达投资管理公司总经理，天治基金管理有限公司筹备组成员、副总经理、监事长，东北证券有限责任公司副总裁，东北证券股份有限公司副总裁、合规总监；现任本公司总经理。

田瑞璋先生，独立董事，大学本科。历任中国北方工业(集团)总公司副总经理，中国兵器工业总公司总经济师、副总经理、党组成员(副部级)，中国工商银行党委副书记、副行长、中央金融工委委员(副部级)，工商东亚金融控股有限公司全国政协委员、工商东亚董事长；现任中国扶贫开发协会常务副会长(中组部任命、副部级)、中国金融学会常务理事、中国城市金融学会副会长、中国宏观经济学会常务理事、渤海银行独立董事、晋商银行独立董事。

金硕先生，独立董事，教授。历任吉林大学总务办公室副主任、副教授、教授，长春税务学院党委书记、院长，长春市政协委员，吉林省政协委员、文教卫生委员会副主任；现任吉林财经大学党委书记。

关雪凌女士，独立董事，经济学博士。历任中国人民大学东欧中亚研究所副所长、所长；现任中国人民大学俄罗斯研究中心主任、国务院发展研究中心欧亚社会发展研究所特约高级研究员、中国俄罗斯东欧中亚学会常务理事。

2. 监事会成员

何俊岩先生，监事长，会计学学士，高级会计师。历任吉林省五金矿产进出口公司财务

科长,东北证券有限责任公司计划财务部总经理、受托资产管理总部总经理,本公司监事长;现任东北证券股份有限公司副总裁兼财务总监。

李绍科先生,监事,大专,高级经济师。历任北京新富投资集团有限公司副总经济师,联合置地房地产开发有限公司总经济师,北京莱富建设有限公司总经济师,北京绿城投资有限公司总经济师;现任中辉国华实业(集团)有限公司总经济师。

杨晓燕女士,监事,哲学硕士,金融学研究生,高级经济师。曾任职北京银行等金融机构,17年金融、证券从业经历;现任本公司监察稽核部经理。

3. 其他高级管理人员

单宇先生,总经理,简历请参见董事介绍。

王兴宇先生,副总经理,美国宾西法尼亚印第安那大学工商管理硕士、美国依阿华大学法律学硕士;具有6年基金从业经历和5年保险从业经历,曾任中法人寿保险有限责任公司宣传公关及法律部经理、董事会秘书,先后任职于博时基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、益民基金管理有限公司。2009年9月加盟本公司。

吕日先生,督察长,吉林大学经济学院政治经济学专业博士研究生,高级经济师。曾担任吉林省证券公司长春北国之春营业部副经理、延吉证券营业部副经理、营业机构管理部经理;东北证券股份有限公司总裁助理兼营销交易管理总部总经理。2008年11月加盟本公司。

4. 本基金基金经理

姓名	任职时间	简历
庞飒(先生)	2010-9-16	浙江大学生命科学院理学硕士,11年证券从业经历。曾任申银万国证券研究所行业分析师,富国基金行业分析师,汇添富基金管理有限公司高级研究员、研究主管、基金经理、投资决策委员会委员及基金投资部副总监。2010年5月加盟东方基金管理有限责任公司,现任总经理助理、投资总监、投资决策委员会副主任委员。
李骥(先生)	2010-2-12	北京大学经济学博士,10年证券从业经历,曾任嘉实基金管理有限公司研

		究部副总监，长盛基金管理有限公司研究部副总监。2007年9月加盟东方基金管理有限责任公司，曾任研究部经理，现任首席策略分析师，投资决策委员会委员。
付勇（先生）	2006年1月11日至2010年2月12日任本基金基金经理	
于鑫（先生）	2007年7月20日至2008年9月20日任本基金基金经理	

5. 投资决策委员会成员

单宇先生：总经理，投资决策委员会主任委员。简历请参见董事介绍。

庞飒先生：总经理助理兼投资总监，本基金基金经理，投资决策委员会副主任委员。简历请参见本基金基金经理介绍。

张岗先生：西北大学经济学博士，10 年证券从业经历。历任健桥证券股份有限公司行业公司部经理，天治基金管理公司研究员、天治财富增长混合型证券投资基金基金经理（2006 年 3 月-2007 年 4 月），投资副总监、投资决策委员会委员，建信基金管理公司专户投资部总监助理、副总监。2010 年 4 月加盟本公司，现任东方核心动力股票型开放式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基金经理，研究部经理，投资决策委员会委员。

于鑫先生：东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理，东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理，基金管理部经理，投资决策委员会委员。清华大学 MBA，CFA；10 年证券从业经历，曾任世纪证券有限公司资产管理部投资经理；2005 年加盟本公司。

李骥先生：首席策略分析师，本基金基金经理，投资决策委员会委员。简历请参见本基金基金经理介绍。

6. 上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人职责

1. 基金管理人的权利

- (1) 运用基金财产；
- (2) 获得基金管理人报酬；
- (3) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (4) 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、非

交易过户、转托管等业务的规则;

(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人, 对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为, 对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形, 应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构, 并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;

(6) 在基金合同约定的范围内, 拒绝或暂停受理申购和赎回申请;

(7) 选择、更换注册登记机构, 并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;

(8) 选择、更换销售代理机构, 并依据销售代理协议和有关法律法规, 对其行为进行必要的监督和检查;

(9) 在基金托管人更换时, 提名新的基金托管人;

(10) 依法召集基金份额持有人大会;

(11) 法律法规规定的其他权利。

2. 基金管理人的义务

(1) 依法募集基金, 办理或者委托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、勤勉尽责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) 计算并公告基金资产净值, 确定基金份额申购、赎回价格;

(9) 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;

(10) 按规定受理申购和赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;

(11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

- (12) 编制中期和年度基金报告;
- (13) 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;
- (14) 保守基金商业秘密, 不得泄露基金投资计划、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, 不得向他人泄露;
- (15) 按照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收益;
- (16) 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;
- (17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
- (18) 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者实施其他法律行为;
- (19) 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;
- (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, 应当承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;
- (21) 基金托管人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托管人追偿;
- (22) 法律法规规定的其他义务。

(四) 基金管理人的承诺

1. 基金管理人承诺不从事任何违反《证券法》、《基金法》以及其他相关法律法规的行为, 并承诺建立健全内部控制制度, 采取有效措施, 积极防止此类行为的发生。

2. 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) 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牟取利益;
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
- (5) 依照法律、行政法规有关规定, 由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。

3. 基金经理承诺

(1) 依照有关法律法规和基金合同的规定, 本着敬业、诚信和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、或任何第三者谋取利益;

(3) 不泄露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;

(4) 不担任基金托管人或者其他基金管理人的任何职务, 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

1. 内部控制制度

(1) 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。

(2) 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

内部稽核人员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及内部控制委员会、督察长对公司和基金的合法合规性进行监督。

合规及内部控制委员会在董事会领导下, 对公司固有资产和基金资产运作的合法合规性进行全面、重点的跟踪分析并提出改进方案, 调整、确定公司的内部控制制度并评估其有效性, 其目的是完善董事会的合规监控功能, 建立良性的公司治理结构。

督察长负责合规及内部控制委员会决议的具体执行, 按照中国证监会的规定和合规及内部控制委员会的授权对公司和基金运作的合规合法性进行监督稽核。

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、风险控制委员会和金融工程部、监察稽核部;

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金融工程部使用数量化的风险管理系统, 对基金投资的绩效和风险进行数量化评估, 形成基金投资的绩效评价和风险控制评价。

④监察稽核部是公司基金运作的监察稽核部门, 负责对公司和基金运作的合法合规性及内部控制制度的建立和执行情况进行监察稽核。

第三层次: 各职能部门对各自业务的自我检查和控制。

公司各职能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,根据公司经营计划、业务规划和各部门的具体情况制订本部门的业务管理规定、操作流程及内部控制规定,并严格执行,将风险控制在最小范围内。

<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。

2. 基金管理人关于内部控制的声明

(1)本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任,董事会承担最终责任;

(2)上述关于内部控制的披露真实、准确;

(3)本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

四 基金托管人

(一) 基金托管人概况

1. 基本情况

名称:中国民生银行股份有限公司(以下简称“中国民生银行”)

住所:北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人:董文标

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：股份有限公司（上市）

注册资本：22,262,277,489 元人民币

存续期间：持续经营

电话：010-58560666

联系人：关悦

中国民生银行于1996年1月12日在北京正式成立，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。中国民生银行成立十五年来，业务不断拓展，规模不断扩大，效益逐年递增，并保持了良好的资产质量。

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。

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。

中国民生银行在“2006 民营上市公司 100 强”中位列第一名，并在市值、社会贡献两项分榜单中名列第一。

在《福布斯》中文版评选的“2006 中国顶尖企业十强榜”上，民生银行位列第七名。

2007年10月，中国民生银行通过了SAI国际组织颁布的SA8000体系认证（即企业社会责任管理体系），成为中国金融界第一家通过该项认证的商业银行。

2007年11月，民生银行获得2007第一财经金融品牌价值榜十佳中资银行称号，同时荣获《21世纪经济报道》等机构评选的“最佳贸易融资银行奖”。

2007年12月,民生银行荣获《福布斯》颁发的第三届“亚太地区最大规模上市企业50强”奖项。

2008年7月,民生银行荣获“2008年中国最具生命力百强企业”第三名

在《2008中国商业银行竞争力评价报告》中民生银行核心竞争力排名第6位,在公司治理和流程银行两个单项评价中位列第一。

2009年6月,民生银行在“2009年中国本土银行网站竞争力评测活动”中获2009年中国本土银行网站“最佳服务质量奖”。

2009年9月,在大连召开的第二届中国中小企业融资论坛上,中国民生银行被评为“2009中国中小企业金融服务十佳机构”。在“第十届中国优秀财经证券网站评选”中,民生银行荣膺“最佳安全性能奖”和“2009年度最佳银行网站”两项大奖。

2009年11月21日,在第四届“21世纪亚洲金融年会”上,民生银行被评为“2009年·亚洲最佳风险管理银行”。

2009年12月1日,中国民生银行获得了“2008年度中国上市公司百强榜第13名”。

2009年12月9日,在由《理财周报》主办的“2009年第二届最受尊敬银行评选暨2009年第三届中国最佳银行理财产品评选”中,民生银行获得了“2009年中国最受尊敬银行”、“最佳服务私人银行”、“2009年最佳零售银行”多个奖项。

2010年2月3日,在“卓越2009年度金融理财排行榜”评选活动中,中国民生银行一流的电子银行产品和服务获得了专业评测公司、网友和专家的一致好评,荣获卓越2009年度金融理财排行榜“十佳电子银行”奖。

2010年5月20日,在2010年英国《金融时报》中国银行业成就奖颁奖典礼上,中国民生银行从众多竞争者中脱颖而出,荣获“最佳贸易金融银行奖”。

2010年10月,在经济观察报主办的“2009年度中国最佳银行评选”中,民生银行获得评委会奖——“中国银行业十年改革创新奖”。这一奖项是评委会为表彰在公司治理、激励机制、风险管理、产品创新、管理架构、商业模式六个方面创新表现卓著的银行而特别设立的。

2010年12月1日,在《亚洲货币》杂志(Asiamoney)公布的年度最佳公司治理票选结果中,民生银行在中国区组别中获得最高票数,成为年度中国区最佳公司治理企业。

2011年6月22日,在由《理财周报》主办的“2011中国上市公司最佳董事会价值管理论坛”上,民生银行荣获“2011中国主板上市公司最佳董事会10强”。

2. 主要人员情况

陈凌：女，高级会计师。资产托管部总经理。曾任职于中国有色金属工业总公司财务部，中国有色财务公司，招商银行北京分行，中国民生银行股份有限公司总行营业部、北京管理部、西安分行、总行年金筹备组；历任中国有色财务公司处长，中国民生银行股份有限公司总行营业部副主任、北京管理部副总经理、西安分行行长、总行年金筹备组组长等职务。具有丰富的大型企业集团、非银行金融机构及商业银行的从业工作经历和管理工作经验。

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43人，平均年龄35岁，100%员工拥有大学本科以上学历，80%以上员工具有硕士以上文凭。基金业务人员100%都具有基金从业资格。截止到2011年6月30日，本行共托管基金10只，分别为天治品质优选混合型证券投资基金、融通易支付货币市场证券投资基金、东方精选混合型开放式证券投资基金、天治天得利货币市场基金、东方金账簿货币市场基金、长信增利动态策略证券投资基金、华商领先企业混合型证券投资基金、银华深证100指数分级证券投资基金、华商策略精选灵活配置混合型证券投资基金和光大保德信信用添益债券型证券投资基金。托管基金资产净值为337.78亿元。

(二) 基金托管人的内部控制制度

1. 内部风险控制目标

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

2. 内部风险控制组织结构

中国民生银行股份有限公司基金托管业务内部风险控制组织结构由中国民生银行股份有限公司稽核部、资产托管部内设稽核监督处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核部对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内设独立、专职的内部监督稽核处，负责拟定托管业务风险控制工作总体思路与计划，组织、指导、协调、监督各业务处室风险控制工作的实施。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)全面性原则：风险控制必须覆盖资产托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(2)独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监督处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

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

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

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

4. 内部风险控制制度和措施

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

(2)建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

(3)风险识别与评估：稽核监督处指导业务处室进行风险识别、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处室和业务岗位,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,横向多处室制的内部组织结构,形成不同处室、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稽核监督处,依照有关法律规章,每两个月对业务的运行进行一次稽核检查。总行稽核部也不定期对资产托管部进行稽核检查。

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

(三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

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

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

五 相关服务机构

(一) 直销机构:

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: 杨树财

联系人: 邹楠

电话: 010-66295921

传真: 010-66578690

网址: www.orient-fund.com 或 www.df5888.com

(二) 代销机构:

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: 董文标

联系人: 董云巍

电话: 010-58351666

传真: 010-83914283

客户服务电话: 95568

网址: www.cmbc.com.cn

2. 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: 郭树清

联系人: 王琳

传真: 010-66275654

客户服务电话: 95533

网址: www.ccb.com

3. 中国工商银行股份有限公司

住所: 中国北京复兴门内大街 55 号

办公地址: 中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人: 姜建清

联系人: 李康

电话: 010-66107900

传真: 010-66108013

客户服务电话: 95588

网址: www.icbc.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: 秦晓

联系人: 邓炯鹏

电话: 0755-83077278

传真: 0755-83195109

客户服务电话: 95555

网址: www.cmbchina.com

5. 中国邮政储蓄银行有限责任公司

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 A 座

法定代表人: 刘安东

联系人: 陈春林

电话: 010-68858095

客户服务电话: 11185

网址: www.psbc.com

6. 北京银行股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址: 北京市西城区金融大街丙 17 号首层

法定代表人: 闫冰竹

联系人: 王曦

电话: 010-66223584

客户服务电话: 95526

网址: www.bankofbeijing.com.cn

7. 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: 孔丹

联系人: 宋晓明

电话: 010-65541585

传真: 010-65541230

客户服务电话: 95558

网址: bank.ecitic.com

8. 兴业银行股份有限公司

住所: 福州市湖东路 154 号

办公地址: 上海市江宁路 168 号兴业大厦 9 楼

法定代表人: 高建平

联系人: 刘玲

电话: 021-52629999

传真: 021-62569070

客户服务电话: 95561

网址: www.cib.com.cn

9. 交通银行股份有限公司

住所: 上海市银城中路 188 号

办公地址: 上海市银城中路 188 号

法定代表人: 胡怀邦

联系人: 蔡雪

电话: 021-58781234

传真: 021-58408842

客户服务电话: 95559 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址: www.95559.com.cn

10. 东北证券股份有限公司

住所: 长春市自由大路 1138 号

办公地址: 长春市自由大路 1138 号

法定代表人: 矫正中

联系人: 潘凯

电话: 0431-85096709

客户服务电话: 4006000686

网址: www.nesc.cn

11. 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: 顾伟国

联系人: 李洋

电话: 010-66568888

传真: 010-66568536

客户服务电话: 400-888-8888

网址: www.chinastock.com.cn

12. 中信证券股份有限公司

住所: 深南大道 7088 号招商银行大厦 A 层

办公地址: 北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦 3 层

法定代表人: 王东明

联系人: 陈忠

电话: 010-84683893

传真: 010-84865560

客户服务电话: 各地营业部咨询电话

网址: www.ecitic.com

13. 申银万国证券股份有限公司

住所: 上海市常熟路 171 号

办公地址: 上海市常熟路 171 号

法定代表人: 丁国荣

联系人: 李清怡

电话: 021-54033888

传真: 021-54035333

客户服务电话: 021-962505

网址: www.sw2000.com.cn

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: 王立群

电话: 021-23219286

传真: 021-23219100

客户服务电话: 021-95553、400-8888-001 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址: www.htsec.com

15. 中信建投证券有限责任公司

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: 张佑君

联系人: 权唐

电话: 010-85130588

传真: 010-65182261

客户服务电话: 400-8888-108

网址: www.csc108.com

16. 山西证券股份有限公司

住所: 山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址: 山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人: 侯巍

联系人: 郭熠

电话: 0351-8686659

传真: 0351-8686619

客户服务电话: 400-666-1618

网址: www.i618.com.cn

17. 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: 徐浩明

联系人: 刘晨

电话: 021-22169999

传真: 021-22169134

客户服务电话: 10108998

网址: www.ebscn.com

18. 东海证券有限责任公司

住所: 江苏省常州市延陵西路 59 号投资广场 18 楼

办公地址: 上海市浦东新区东坊路 989 号中达广场 13 楼

法定代表人: 朱科敏

联系人: 霍小菲

电话: 0519-50586660

传真: 021-50585607

客户服务电话: 400-888-8588

网址: www.longone.com.cn

19. 国泰君安证券股份有限公司

住所: 上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：万建华

联系人：吴倩

电话：021-38676767

客户服务电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

20. 中信金通证券有限责任公司

住所：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法定代表人：刘军

联系人：丁思聪

电话：0571-85112510

传真：0571-85783771

客户服务电话：0571-96598

网址：www.bigsun.com.cn

21. 国元证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市寿春路 179 号

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

联系人：祝丽萍

电话：0551-2207938

传真：0551-2207965

客户服务电话：400-8888-777

网址：www.gyzq.com.cn

22. 中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真: 0532-85022026

客户服务电话: 0532-96577

网址: www.zxwt.com.cn

23. 东方证券股份有限公司

住所: 上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

办公地址: 上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人: 王益民

联系人: 吴宇

电话: 021-63325888

传真: 021-63326173

客户服务电话: 021-962506 或 40088-88506

网址: www.dfzq.com.cn

24. 广发证券股份有限公司

住所: 广东省广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址: 广州市天河北路 183 号大都会广场 18、19、36、38、41、42 楼

法定代表人: 林治海

联系人: 黄岚

电话: 020-87555888

传真: 020-87555305

客户服务电话: 95575

网址: www.gf.com.cn

25. 华泰证券股份有限公司

住所: 南京市中山东路 90 号

办公地址: 南京市中山东路 90 号

法定代表人: 吴万善

联系人: 程高峰

电话: 025-84457777

传真: 025-84579763

客户服务电话: 95577

网址: www.htsc.com.cn

26. 安信证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址: 深圳市福田区深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人: 牛冠兴

联系人: 陈剑虹

电话: 0755-82558305

传真: 0755-82558355

客户服务电话: 4008001001

网址: www.essence.com.cn

27. 国信证券股份有限公司

住所: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人: 何如

联系人: 齐晓燕

电话: 0755-82130833

传真: 0755-82133302

客户服务电话: 95536

网址: www.guosen.com.cn

28. 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: 胡运钊

联系人: 李良

电话: 021-63219781

传真: 86-27-85481900

客户服务电话: 4008-888-999 或 027-85808318

网址: www.cjsc.com

29. 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: 宫少林

联系人: 林迎生

电话: 0755-82943666

传真: 0755-82943636

客户服务电话: 95565、4008888111

网址: www.newone.com.cn

30. 齐鲁证券有限公司

住所: 山东省济南市经十路 128 号

办公地址: 山东省济南市千佛山路 3 号济南商业银行四楼

法定代表人: 李玮

联系人: 吴阳

电话: 0531-81283938

传真: 0531-81283900

客户服务电话: 95538

网址: www.qlzq.com.cn

31. 江海证券经纪有限责任公司

住所: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址: 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人: 孙名扬

联系人: 张宇宏

电话: 0451-82287211

传真: 0451-82269290

客户服务电话: 400-666-2288

网址: www.jhzq.com.cn

32. 中国银行股份有限公司

住所: 北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼

法定代表人：肖 钢

联系人：宋亚萍

电话：010-66596688

传真：010-66594946

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

33. 宏源证券股份有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

电话：010-88085338

传真：010-88085344

客户服务电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

34. 广发华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8、10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-87841160

传真：0591-87841150

客户服务电话：96326

网址：www.gfhfzq.com.cn

35. 华泰联合证券有限责任公司

住所：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

法定代表人：马昭明

联系人：庞晓芸

电话: 0755-82492000

传真: 0755-82492962

客户服务电话: 95513

网址: www.lhzq.com

(三) 注册登记机构

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: 杨树财

联系人: 王广辉

电话: 010-66295872

传真: 010-66578680

网址: www.orient-fund.com

(四) 律师事务所和经办律师

名称: 北京市德恒律师事务所

住所: 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 12 层

办公地址: 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 12 层

负责人: 王丽

联系人: 徐建军

电话: 010-66575888

传真: 010-65232181

经办律师: 徐建军 李晓明

(五) 会计师事务所和经办注册会计师

名称: 立信会计师事务所有限公司

住所: 上海市南京东路 61 号新黄浦金融大厦 4 层

办公地址: 上海市南京东路 61 号新黄浦金融大厦 4 层

法定代表人: 朱建弟

联系人: 朱锦梅

电话: 010-68015062

传真: 010-68018480

经办注册会计师: 朱锦梅、魏星

六 基金的募集与基金合同的生效

(一) 本基金根据 2005 年 9 月 7 日中国证券监督管理委员会《关于同意东方精选混合型开放式证券投资基金募集的批复》(证监基金字【2005】153 号)和《关于东方精选混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函【2005】273 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: 2005 年 11 月 21 日至 2006 年 1 月 6 日

募集份额为: 345,758,456.53 份

有效户数为: 4,076 户

(四) 本基金根据《关于精选混合型开放式证券投资基金备案确认的函》(基金部函【2006】4 号)的核准,于 2006 年 1 月 11 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。

七 基金份额的申购与赎回

(一) 申购与赎回的办理场所

1. 基金管理人的直销网点。本公司分别在北京、上海设立了直销柜台。

2. 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代销机构销售网点。目前的代销机构为中国民生银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行有限责任公司、北京银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、东北证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、中信金通证券有限责任公司、国元证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、

东方证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、江海证券经纪有限责任公司、中国银行股份有限公司、宏源证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司。以上代销机构的住所同第五章所述。本基金管理人可根据情况增减基金代销机构，并予以公告。

3. 投资者可通过本基金直销机构或指定的代销机构按照规定的方式进行申购或赎回。

(二) 申购与赎回的办理时间

1. 本基金申购赎回的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。

2. 基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

3. 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，本基金管理人将视情况对前述开放日进行相应的调整并公告。

4. 本基金自2006年1月20日开始正常申购；自2006年4月10日开始正常办理赎回。

(三) 申购限制

本基金管理人可根据市场情况，在不损害基金份额持有人权益的情况下，调整首次申购的金额和赎回的份额的数量限制，调整前的3个工作日内基金管理人必须在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

(四) 申购和赎回的程序

1. 申购和赎回的申请方式

基金投资者须按基金销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。基金投资者提交申购申请时，须按销售机构规定的方式备足申购资金，基金投资者交付款项，申购申请即为有效。基金份额持有人提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够的基金份额余额。

2. 申购和赎回的确认

当日（T日）规定时间受理的申请，基金管理人自收到基金投资者申购、赎回申请之日起2个工作日内，对该申购、赎回的有效性进行确认。正常情况下基金投资者可从T+2工作日起直接到其办理业务的销售网点查询确认情况，打印确认单。

3. 申购和赎回款项支付的方式和时间

基金投资者申购时，采用全额缴款方式，若资金未全额到账则视为无效申购，申购无效

的款项将退回申购人。基金份额持有人赎回申请确认后,正常情况下应当自接受基金份额持有人有效赎回申请之日起7个工作日内支付赎回款项。

(五) 申购和赎回的数额和价格

1. 申购和赎回的数额、余额的处理方式

(1)在直销机构销售网点首次申购的最低金额为人民币1,000元,超过部分不设最低级差限制;追加申购的最低金额为人民币1,000元,超过1,000元的部分不设最低级差限制;已在直销机构销售网点有认购基金记录的基金投资者不受首次申购最低金额的限制,但受追加申购最低金额的限制;在代销机构销售网点首次申购的最低金额为人民币1,000元,超过1,000元的部分不设最低级差限制;追加申购的最低金额为人民币1,000元,超过1,000元的部分不设最低级差限制;

(2)赎回的最低份额为500份基金份额,基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回,但某笔赎回导致在一个销售机构的基金份额余额少于500份时,余额部分基金份额必须一并赎回;

(3)单个基金份额持有人在一個销售机构持有本基金的最低限额为500份;

(4)申购份额、余额的处理方式:申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值,有效份额单位为份,保留小数点后两位,小数点后两位以后的部分舍去,舍去部分所代表的资产计入基金资产;

(5)赎回金额的处理方式:赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值,并扣除相应的赎回费用,赎回金额单位为元。赎回费用的计算结果保留小数点后两位,小数点后两位以后的部分舍去;赎回金额的计算结果按四舍五入方法,保留到小数点后两位。由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

2. 申购份额的计算

如果投资者选择交纳前端申购费用,则申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后,以当日基金份额净值为基准计算保留小数点后两位,小数点两位以后的部分舍去,由此产生的误差计入基金财产。

申购份额的计算方式如下:

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

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

对于申购费用为固定金额的基金申购业务, 净申购金额=申购金额-固定申购费金额。

申购费以人民币元为单位, 保留小数点后两位, 小数点后两位以后舍去, 由此产生的误差计入基金财产。

如果投资者选择交纳后端申购费用, 则申购份额及后端申购费用的计算方法如下:

申购基金时,

基金份额=申购确认金额 / 申购当日基金份额净值

赎回基金份额时, 投资人应缴纳后端申购费,

后端申购费=赎回基金份额×基金份额申购当日份额净值×对应的后端申购费率

3. 赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中:

赎回总额=赎回份数×赎回当日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

赎回费以人民币元为单位, 保留小数点后两位, 小数点后两位以后舍去, 由此产生的误差计入基金财产。

4. T 日基金份额净值的计算

T 日基金份额净值为 T 日基金资产净值除以当日基金份额。T 日的基金份额净值在当天收市后计算, 精确到 0.0001 元, 小数点后第五位四舍五入, 于 T+1 日公告。

(六) 不再接受或暂停接受申购和赎回申请的情况

1. 在如下情况下, 基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购申请:

(1) 不可抗力。

(2) 证券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。

(3) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

(4) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分。

(5) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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。

2. 暂停赎回的条件

本基金管理人应当按时支付赎回款项,但是下列情形除外:

- (1) 因不可抗力导致本基金管理人不能支付赎回款项;
- (2) 证券交易场所依法决定临时停市,导致本基金管理人无法计算当日基金资产净值;
- (3) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回,导致本基金的现金支付出现困难;
- (4) 法律法规规定或经中国证监会批准的其他情形。

第(1)项规定的情形消失后,本基金管理人应当及时支付赎回款项。

发生上述情形之一的,本基金管理人应当在当日报国务院证券监督管理机构备案。已接受的申请,本基金管理人应足额兑付;如暂时不能足额兑付,可兑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,未兑付部分由本基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以兑付,并以该开放日当日的基金份额净值为依据计算赎回金额。基金份额持有人在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

3. 发生基金合同或招募说明书中未予载明的重大事项,但本基金管理人认为需要暂停接受基金申购、赎回申请的,报经中国证监会批准后可以暂停接受基金投资者的申购、赎回申请。

4. 暂停基金的申购、赎回,基金管理人应及时在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

5. 在暂停的情况消除时,本基金管理人应及时恢复办理申购或赎回业务。暂停期间结束,基金重新开放时,本基金管理人应予公告。

如果发生暂停的时间为一天,本基金管理人将于重新开放日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体刊登基金重新开放申购或赎回的公告,并公告最新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周,暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,本基金管理人将提前 1 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体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新的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周,暂停期间,本基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次;当连续暂停时间超过两个月时,可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束,基金重新开放申购或赎回时,本基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体连续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新的基金份额净值。

(七) 巨额赎回的情形及处理方式

1. 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)超过前一日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

2. 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顺延赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分顺延赎回：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日基金总份额的 10% 的前提下，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；投资人未能赎回部分，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，当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额。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。

(八) 基金转换

为方便基金份额持有人，本公司已在直销中心、中国建设银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司等开通本基金和本公司管理的其他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。

(九) 基金的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一基金份额持有人基金账户转移到另一基金份额持有人基金账户的行为。

基金注册登记机构只受理继承、捐赠、司法执行等情况下的非交易过户。其中，“继承”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的情形；“司法执行”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、社会团体或其他组织。无论在上述何种情况下,接受划转的主体应符合相关法律和基金合同规定的持有本基金份额的条件。办理非交易过户必须提供相关资料。

对于符合条件的非交易过户申请按《开放式基金业务规则》的有关规定办理。

(十) 基金的转托管

本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个交易账户转入另一个交易账户进行交易。具体办理方法参照《开放式基金业务规则》的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

(十一) 定期定额投资计划

为方便投资者或基金份额持有人,本基金自2007年12月10日起在中国邮政储蓄银行有限责任公司、2008年1月31日起在兴业银行股份有限公司、3月17日起在招商银行股份有限公司、5月29日起在建设银行股份有限公司和北京银行股份有限公司、7月14日起在民生银行股份有限公司和中信建投证券有限责任公司、10月13日起在海通证券股份有限公司、中信金通证券有限责任公司及兴业证券股份有限公司、10月30日起在广发证券股份有限公司、11月25日起在东北证券股份有限公司、2009年2月9日起在招商证券股份有限公司、2月11日起在中信银行股份有限公司、6月30日起在齐鲁证券有限公司、7月23日起在工商银行股份有限公司、9月8日起在江海证券有限公司、11月20日起在国信证券股份有限公司、2010年1月12日起在广发华福证券有限责任公司、7月7日起在安信证券股份有限公司、2011年5月17日起在中信证券股份有限公司等开始办理定期定额投资业务(前端);通过本公司网上交易平台,于2008年11月7日起开通农行金穗卡、2009年4月3日起开通招行一卡通(借记卡)、8月7日起开通民生银行借记卡、2010年5月21日起开通上海浦东发展银行卡和广东发展银行卡等定期定额投资业务(前端),未来在各项技术条件和准备完备的情况下,将在其它渠道酌情增加本基金的定期定额投资业务。

(十二) 基金的冻结及解冻

基金注册登记机构受理的基金账户或是基金份额的冻结与解冻。基金账户或是基金份额被冻结的,被冻结部分产生的权益一并冻结,被冻结部分份额仍然参予每日收益分配与支付。

八 基金的投资

(一) 投资目标

深入研究中国经济高速增长的根本动力,重点投资于高速成长的优质上市公司,努力使

基金份额持有人最大限度的分享中国经济的高速增长。

(二) 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,主要包括国内依法发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

本基金的重点投资对象为经过严格筛选的卓越的成长性公司。本基金投资这类公司股票的比例将不低于基金股票资产的60%。

(三) 投资策略

本基金的投资管理由自上而下的大类资产配置和自下而上的精选个股(包括债券)、行业优化组成。

1. 决策依据及投资程序

(1)研究部和基金管理部通过自身的研究力量,并借助外部的研究机构,对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究,形成有关的各类报告,为本基金的投资管理提供决策依据。

(2)投资决策委员会定期召开会议,讨论形成本基金的资产配置比例指导意见;如遇重大事项,投资决策委员会及时召开临时会议做出决策。

(3)基金经理根据投资决策委员会的决议,参考上述报告,并结合自身的分析判断,形成基金投资计划,主要包括行业配置和投资组合管理。

(4)交易部依据基金经理的指令,制定交易策略,统一进行具体品种的交易;基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

(5)投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施,金融工程小组对投资组合计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制,基金经理依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险。

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做出调整。

在大类资产配置环节,本基金在综合宏观因素分析、资本市场、品种分析的基础上,应用本基金管理人大盘趋势预测模型,结合本基金资产配置限制,制定最优的资产配置策略。

2. 投资管理的方法和标准

(1)资产配置在确定本基金各大类资产的投资范围时,本基金管理人主要考虑以下几个要素:

①在中国经济高速成长的过程中,必然会涌现出一批卓越的成长性公司,投资他们并分享成长,是财富保值增值最有效的手段,因此本基金将主要投资于这些成长性股票;

②由于目前证券市场上没有有效的衍生产品作为避险工具,也不能卖空,在预期股市下跌的情况下,本基金将增加固定收益类品种(债券或货币市场工具)的比重,以规避股票市场下跌的系统性风险;

③在基金日常管理中,有调整组合、申购新股及应付赎回的需要,因此正常情况下本基金投资组合中需要保留少量现金。

在实际管理过程中,本基金管理人将依据市场的阶段性变化,动态调整三类资产的配置比例,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于5%。本基金的资产类别配置范围如下表所示:

表 基金资产类别配置范围

资产类别	最低比例	最高比例
股票	30%	95%
债券	0%	65%
货币市场工具	5%	70%

(2) 行业配置

本基金的行业配置是为了避免精选出来的股票在单一行业集中度过高而造成系统风险过高的一种优化手段,主要工具是本基金管理人开发的行业投资价值评级体系。

(3) 个股选择在个股选择环节,本基金以定量选股模型进行初选,然后通过定量和定性分析精选出那些卓越的成长性公司,并将这类公司的股票作为投资的重点。本基金管理人建立了五个层次的股票筛选体系,通过层层筛选,得到最具投资价值的个股构成本基金核心股票池。首先从投资基准出发,投资基准中通过财务品质检验后的股票进入本基金初选股票池即本基金股票基础库;然后本基金初选股票池中通过定量成长性股票选择后的股票进入本基金备选股票池即本基金优选库;最后,本基金备选股票池中通过成长性公司精选后的股票进入本基金核心股票池即本基金精选库。我们将成长型公司分成两类,一类是持续稳定成长型公司,另一类是周期性成长的公司。在实际投资过程中,对持续稳定成长类公司的股票采取“长期持有”的策略,对周期性成长公司的股票采取“动量投资”的策略。

本基金管理人将定期和不定期审视各级股票池,根据公司基本面变化,对其进行调整。

(4) 债券投资策略

债券投资的风险因素如果按照其对超额收益的贡献程度大小排序依次为久期、期限结构、类属配置和个债选择,我们针对每一类别的风险设计相应的管理方法而形成本基金债券

组合部分的投资策略。

(四) 业绩比较基准

根据本基金的特征,选择中信标普 300 成长指数作为本基金股票部分的业绩比较基准,选择中信标普全债指数作为债券及货币市场工具的比较基准。

对于权重配置,作为一只混合型基金,股票最低仓位为 30%,最高为 95%,一般情况下为 60%,因此本基金的业绩比较基准为:

本基金业绩比较基准=中信标普 300 成长指数*60% + 中信标普全债指数*40%

本基金选择中信标普 300 成长指数作为股票投资部分的业绩比较基准是基于以下几个原因:

1. 只有将所评价的基金与其风格相似的组合进行比较才能正确衡量基金业绩;
2. 该指数遵循富时指数一致的基本编制方法,保证全球范围内的可比性;
3. 该指数编制方法的透明度高;
4. 该指数遵循全球行业分类标准(GICS),容易被全球投资者广泛接受。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,本基金可以变更业绩比较基准。

(五) 投资限制

1. 基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (1) 承销证券;
- (2) 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,但是国务院另有规定的除外;

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券;

- (7) 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;

- (8) 依照法律、行政法规有关规定,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

2. 本基金投资组合比例限制

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票,其市值不得超过本基金资产净值的 10%;

(2) 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；

(3) 本基金持有的现金及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%；

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

(5) 股票、债券和现金的投资比例应符合本基金合同规定的投资比例限制；

(6) 权证投资比例限制：

① 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该基金资产净值的0.5%；

② 本基金持有的全部权证市值不得超过该基金资产净值的3%；

③ 本公司管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

④ 因证券市场波动、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组合不符合②、③项规定的，基金管理人应当在十个交易日内调整完毕；

(7) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

基金的投资组合应在基金合同生效之日起6个月内达到规定的标准。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金的投资组合应在基金合同生效之日起6个月内达到规定的标准。

(六) 基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1. 处理原则：

(1) 不谋求对所投资企业的控股或者进行管理；

(2) 所有的参与均在合法合规的前提下维护基金投资者利益并谋求基金资产的保值和增值。

2. 方法

投资部门人员代表公司出席被投资上市公司股东会议时，应以支持以股东利益最大化为目标的企业经营管理为原则。若涉及重大决策时，如拟对上市公司公司提出的预案投反对票时，应事先召开有投资总监参加的会议讨论，并将讨论结果报备总经理办公会后，指派适当

人员代表基金出席，行使决议事项，并填写会议记录。

(七) 基金投资组合报告

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。

基金托管人根据本基金合同规定，已复核了本报告中的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2011年6月30日（财务数据未经审计）。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,297,396,781.22	56.90
	其中：股票	3,297,396,781.22	56.90
2	固定收益投资	668,200,000.00	11.53
	其中：债券	668,200,000.00	11.53
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	1,241,813,546.31	21.43
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	573,563,801.34	9.90
6	其他各项资产	13,732,116.22	0.24
7	合计	5,794,706,245.09	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	采掘业	—	—
C	制造业	1,556,404,368.39	26.96

C0	食品、饮料	616,099,660.00	10.67
C1	纺织、服装、皮毛	121,273,609.48	2.10
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	22,635,000.00	0.39
C4	石油、化学、塑胶、塑料	232,178,491.23	4.02
C5	电子	180,510,003.68	3.13
C6	金属、非金属	17,970,000.00	0.31
C7	机械、设备、仪表	348,767,604.00	6.04
C8	医药、生物制品	16,970,000.00	0.29
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	525,250,128.08	9.10
F	交通运输、仓储业	87,040,294.40	1.51
G	信息技术业	204,870,092.19	3.55
H	批发和零售贸易	653,283,039.25	11.31
I	金融、保险业	179,757,674.46	3.11
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	90,791,184.45	1.57
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	3,297,396,781.22	57.11

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	000568	泸州老窖	7,800,000	351,936,000.00	6.10
2	000858	五粮液	6,000,000	214,320,000.00	3.71
3	600970	中材国际	6,962,207	190,277,117.31	3.30

4	600036	招商银行	13,806,273	179,757,674.46	3.11
5	600271	航天信息	6,544,900	169,120,216.00	2.93
6	600066	宇通客车	6,600,000	152,724,000.00	2.65
7	600694	大商股份	3,863,703	147,709,365.69	2.56
8	000651	格力电器	5,812,955	136,604,442.50	2.37
9	000501	鄂武商A	7,762,670	132,586,403.60	2.30
10	002042	华孚色纺	4,958,038	121,273,609.48	2.10

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	297,690,000.00	5.16
3	金融债券	370,510,000.00	6.42
	其中：政策性金融债	370,510,000.00	6.42
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	668,200,000.00	11.57

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	110208	11国开08	3,400,000	340,306,000.00	5.89
2	1101029	11央行票据	3,000,000	297,690,000.00	5.16

		29			
3	090205	09国开05	300,000	30,204,000.00	0.52
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8. 投资组合报告附注

(1) 本基金所持有的五粮液(000858)于2011年5月28日对外公告了被处罚的事宜。5月27日中国证监会就四项信披违法事实向五粮液下发了《行政处罚决定书》，证监会决定：对五粮液给予警告，并处以60万元罚款；对唐桥、王国春给予警告，并分别处以25万元罚款；对陈林、郑晚宾、彭智辅给予警告，并分别处以10万元罚款；对叶伟泉、刘中国、朱中玉给予警告，并分别处以3万元罚款。

本基金决策依据及投资程序：

(1) 研究部对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究，形成有关的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。

(2) 投资决策委员会定期召开会议，讨论形成本基金的资产配置比例指导意见。

(3) 基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身的分析判断，形成基金投资计划，主要包括行业配置和投资组合管理。

(4) 交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

(5) 投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施，监察稽核部、金融工程部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。

本基金投资五粮液主要基于以下原因：国内居民收入持续增长与消费结构的升级，是国内中高端白酒行业市场容量不断扩大的主要动力之一；五粮液是白酒行业主要龙头之一，竞争优势明显，相关处罚不影响公司的核心竞争力，同时也有利于公司改善其治理结构；与同行业公司比较，公司估值优势也比较突出。本基金在这一投资过程中严格遵守了上述投资

程序。

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备选股票库之外的股票。

(3)其他资产的构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,706,940.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,481,514.97
5	应收申购款	1,543,661.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,732,116.22

(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的情况。

九 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

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

2006.01.11-2006.12.31	104.21%	1.11%	60.26%	0.85%	43.95%	0.26%
2007.01.01-2007.12.31	168.81%	1.88%	66.73%	1.32%	102.08%	0.56%
2008.01.01-2008.12.31	-56.87%	2.66%	-45.41%	1.82%	-11.46%	0.84%
2009.01.01-2009.12.31	100.81%	1.77%	54.39%	1.29%	46.42%	0.48%
2010.01.01-2010.12.31	-0.99%	1.42%	-2.74%	0.97%	1.75%	0.45%
2011.01.01-2011.03.31	0.71%	1.12%	0.82%	0.85%	-0.11%	0.27%
2011.04.01-2011.06.30	-2.07%	0.67%	-2.89%	0.66%	0.82%	0.01%

(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



注：①根据《东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同》的规定，本基金的资产配置范围为：股票 30%~95%、债券 0%~65%、货币市场工具 5%~70%，基金的投资组合应在基金合同生效之日起 6 个月内达到规定的标准。本报告期内，本基金严格执行了《东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同》的相关规定。

②本基金成立于 2006 年 1 月 11 日，截至 2011 年 6 月 30 日，本基金成立不满六年。

③所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水

平要低于所列数字。

十 基金的财产

(一) 基金财产构成

基金财产是由基金所拥有的股票、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资构成。

(二) 基金财产的账户

基金托管人为基金设立独立的账户,本基金财产与基金托管人的资产以及其他基金的资产实行严格的分账管理。

(三) 基金财产的保管与处分

本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的资产,并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用及其他情形而取得的财产和收益,归入基金财产。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或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、基金托管人以其自有资产承担法律责任,其债权人不得对本基金财产强制执行。

除依《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同及其他有关规定处分外,基金财产不得被处分。

十一 基金资产的估值

(一) 估值日

本基金的估值日为本基金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营业日。

(二) 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、其它投资等资产。

(三) 估值方法

1. 股票估值方法:

(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;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,以最近交易日的收盘价估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,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) 未上市股票的估值:

①首次发行未上市的股票,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送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;

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市价估值;

④非公开发行有明确锁定期的流通受限股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值;

(3)在任何情况下,基金管理人如采用本项第(1)－(2)小项规定的方法对基金资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果基金管理人认为按本项第(1)－(2)小项规定的方法对基金资产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,并与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值;

(4)国家有最新规定的,按其规定进行估值。

2. 债券估值方法:

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,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,以最近交易日的收盘价估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,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)证券交易所市场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(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)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所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,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)发行未上市债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,按成本进行后续计量。

(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)在全国银行间债券市场交易的债券,采用估值技术确定公允价值。

(6)在任何情况下,基金管理人如采用本项第(1)－(5)小项规定的方法对基金资产进行

估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如果基金管理人认为按本项第(1) — (5)小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的, 基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值, 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;

(7) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

3. 权证估值方法:

(1) 基金持有的权证, 从持有确认日起到卖出日或行权日止, 上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值; 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; 估值日没有交易的, 且最近交易日后经济环境发生了重大变化的, 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) 未上市交易的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, 按成本计量;

(3) 因持有股票而享有的配股权, 以及停止交易、但未行权的权证, 采用估值技术确定公允价值。

(4) 在任何情况下, 基金管理人如采用本项第(1)–(3)小项规定的方法对基金财产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如果基金管理人认为按本项第(1)–(3)小项规定的方法对基金财产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, 并与基金托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值。

(5) 国家有最新规定的, 按其规定进行估值。

4. 资产支持证券等其他有价证券按国家有关规定进行估值。

5. 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。

(四) 估值程序

除特殊情况外, 每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值, 并按规定公告。基金份额净值是按照每个开放日闭市后, 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, 小数点后第五位四舍五入, 国家另有规定的, 从其规定。特殊情况是指国家法

法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日,一般指月末、年中以及年终的最后一个自然日。

1. 在本基金的封闭期,基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将基金份额净值结果签章后以书面形式加密发送基金托管人,经基金托管人复核无误签章后,由基金管理人每周对外公布本周最后一个工作日的基金份额净值,公告时间为每周截止日后第1个工作日。

2. 在本基金的开放期,基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将基金份额净值结果签章后以书面形式加密发送基金托管人,经基金托管人复核无误签章后,由基金管理人对外公布。

3. 月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

(五) 估值错误的处理

当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时,视为基金份额净值错误。基金管理人和基金托管人应采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值出现错误时,按照以下约定执行:

1. 差错类型

本基金运作过程中,如果由于基金管理人、基金托管人、注册登记机构、代销机构、投资人自身的过错造成差错,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人(“受损方”)按下述“差错处理原则”给予赔偿,承担赔偿责任。

上述差错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;对于因技术原因引起的差错,若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服,则属不可抗力。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错,因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任,但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2. 差错处理原则

(1) 差错已发生,但尚未给当事人造成损失时,差错责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正差错发生的费用由差错责任方承担;由于差错责任方未及时更正已产生的差错,给当事人造成损失的,由差错责任方承担;若差错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。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认,确保差错已得到更正;

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责, 不对间接损失负责, 并且仅对差错的有关直接当事人负责, 不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。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”), 则差错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差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时, 如果因基金管理人过错造成基金财产损失时, 基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿, 如果因基金托管人过错造成基金财产损失时, 基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产损失, 并拒绝进行赔偿时, 由基金管理人负责向差错方追偿; 追偿过程中产生的有关费用, 应列入基金费用, 从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿, 并且依据法律法规、基金合同或其他规定, 基金管理人或基金托管人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任, 则基金管理人或基金托管人有权向出现过错的当事人进行追索, 并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

3. 差错处理程序

差错被发现后, 有关的当事人应当及时进行处理, 处理的程序如下:

(1) 查明差错发生的原因, 列明所有的当事人, 并根据差错发生的原因以及实际情况确定差错的责任方;

① 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任, 与本基金有关的会计问题, 如经双方在平等基础上充分讨论后, 尚不能达成一致时, 按基金会计责任方的建议执行, 由此给基金份额持有人和基金造成的损失, 由基金管理人负责赔付;

② 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告, 而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明, 份额净值出错且造成基金份额持有人损失的, 应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金, 就实际向投资者或基金支付的赔

偿金额,其中基金管理人承担50%,基金托管人承担50%;

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果,虽然多次重新计算和核对,尚不能达成一致时,为避免不能按时公布基金份额净值的情形,以基金管理人的计算结果对外公布,由此给基金份额持有人和基金造成的损失,由基金管理人负责赔付;

④由于基金管理人提供的信息错误(包括但不限于基金申购或赎回金额等),进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失,由基金管理人负责赔付;

(2)根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;

(3)根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;

(4)根据差错处理的方法,需要修改基金登记结算机构交易数据的,由基金登记结算机构进行更正,并就差错的更正向有关当事人进行确认。

4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下:

(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)错误偏差达到基金资产净值的0.25%时,基金管理人应通报基金托管人,并报告中国证监会;错误偏差达到基金资产净值的0.5%时,基金管理人应通报基金托管人,按本基金合同的规定进行公告,并报中国证监会备案。

(3)因基金份额净值计算错误,给基金或基金份额持有人造成损失的,应由基金管理人先行赔付,基金管理人按差错情形,有权向其他当事人追偿。

(4)基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差,以基金管理人计算结果为准。

(5)由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误,有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因,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,但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误,基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(6)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。

(六) 暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
2. 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;
3. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保障投资人的利

益,已决定延迟估值;

4.如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况,会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的;

5.中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(七) 基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和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。

(八) 特殊情况的处理

1.基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第(3)项、债券估值方法的第(6)项或权证估值方法的第(4)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,或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误,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。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十二 基金的收益与分配

(一) 基金收益的构成

1. 买卖证券差价;
2. 基金投资所得红利、股息、债券利息;
3. 银行存款利息;
4. 已实现的其他合法收入;
5. 证券持有期间产生的公允价值变动。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

(二) 收益分配原则

1. 本基金的每份基金份额享有同等分配权;
2. 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值;
3. 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人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,基金注册登记机构可将投资人的

现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额。

4. 本基金收益每年最多分配6次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的50%;
5. 本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益,按照基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额;基金份额持有人事先未做出选择的,基金管理人应当支付现金;
6. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

(三) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

(四) 收益分配方案的确定与公告

本基金收益分配方案由本基金管理人拟定,由本基金托管人核实,在报中国证监会备案后5个工作日内公告。

十三 基金的费用与税收

(一) 基金运作相关费用

1. 管理费;

基金管理费以基金资产净值的1.5%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给本基金管理人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

2. 托管费;

基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金托管人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

3. 基金合同生效后的信息披露费用;

4. 基金合同生效后的会计师费和律师费;

5. 基金份额持有人大会费用;

6. 基金的证券交易费用;

7. 银行手续费、服务费;

8. 基金分红手续费;

9. 按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

上述第 3 项至第 9 项费用由本基金管理人向基金托管人发出划款指令后,基金托管人按费用实际支出金额从基金财产中支付,列入当期基金费用。

(二) 基金销售相关费用

1. 认购费用

(1) 份额面值: 每份基金份额面值为 1 元

(2) 认购价格: 面值+认购费用

(3) 认购费用:

认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。认购费率按认购金额采用比例费率,投资者在一天之内如果有多笔认购,适用费率按单笔分别计算。费率表如下:

认购金额 (M)	费率 (F)
M<100万	F=1.2%
100万≤M<500万	F=1.0%
M≥500万	按笔收取 1000元/笔

(4) 认购份数的计算公式

认购费用=认购金额×认购费率

认购份数 = $[(\text{认购金额} + \text{认购利息}) - \text{认购费用}] / \text{基金份额面值}$

基金份额面值为 1.00 元。基金份额份数保留小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入基金财产。

例：某投资者投资 5,000 元认购本基金，其认购资金的利息为 3 元，则其可得到的基金份额份数计算如下：

认购费用 = $5,000 \times 1.2\% = 60$ 元

认购份数 = $[(5000 + 3) - 60] / 1.00 = 4,943$ 份

即投资者投资 5,000 元认购本基金，可得到 4,943 份基金份额。

2. 申购费

(1) 申购费率：

本基金的前端申购费按申购金额采用比例费率，申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低，申购费用等于申购金额乘以所适用的申购费率。申购费率按申购金额的大小分为三档，最高不超过 1.5%，具体如下表所示：

申购金额 (M)	费率 (F)
$M < 100$ 万	$F = 1.5\%$
$100 \text{ 万} \leq M < 500 \text{ 万}$	$F = 1.2\%$
$M \geq 500$ 万	按笔收取 1000 元/笔

最低申购金额：1,000 元

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

如果投资者选择交纳后端费用，则费率如下表所示：

持有期限 (Y)	费率 (F)
1 年以内 (含)	$F = 1.8\%$
1 年—3 年 (含)	$F = 1.0\%$
3 年以上	$F = 0$

最低申购金额：1,000 元

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

定期定额申购金额最低 200 元起，费率沿用后端申购、赎回费率。

(2) 申购份额的计算公式

如果投资者选择交纳前端申购费用，则申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除

相应的费用后,以当日基金份额净值为基准计算保留小数点后两位,小数点两位以后的部分舍去,由此产生的误差计入基金财产。

申购份额的计算方式如下:

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

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

对于申购费用为固定金额的基金申购业务, $\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{固定申购费金额}$ 。

申购费以人民币元为单位,保留小数点后两位,小数点后两位以后舍去,由此产生的误差计入基金财产。

如果投资者选择交纳后端申购费用,则申购份额及后端申购费用的计算方法如下:

申购基金时,

$$\text{基金份额} = \text{申购确认金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

赎回基金份额时,投资人应缴纳后端申购费,

$$\text{后端申购费} = \text{赎回基金份额} \times \text{基金份额申购当日份额净值} \times \text{对应的后端申购费率}。$$

(3) 收取方式

本基金采用金额申购、前端及后端收费的形式收取申购费用,投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。

(4) 申购费用的使用

本基金的申购费用由申购人承担,用于市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。

3. 赎回费

(1) 赎回费率:

赎回费率随基金份额持有人持有本基金的时间的增加而递减,即持有时间越长,所适用的赎回费率越低,赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率。如下表所示:

持有期限	赎回费率(F)
1年以内(含)	F=0.5%
1年—3年(含)	F=0.25%
3年以上	F=0

(2) 赎回金额的计算公式:

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。其中，

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份数} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$
$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$
$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

(3) 收取方式：

投资者赎回申请成功后，赎回费按实际确认的有效赎回份额，以当日适用的赎回费率为基准计算。赎回费直接从赎回总额中扣除。

(4) 使用方式：

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，赎回费用的75%用于注册登记费及相关手续费，25%归基金财产。

4. 转换费

为方便基金份额持有人，未来在各项技术条件和准备完备的情况下，投资者可以选择在本基金和东方基金管理有限责任公司管理的其他基金（如有）之间进行基金转换。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定将由基金管理人届时另行规定。

5. 基金管理人可以从本基金财产中计提销售服务费，用于基金的持续销售和服务基金份额持有人，具体办法按中国证监会有关规定执行。

（三）基金税收

本基金及本基金份额持有人依据国家有关规定依法纳税。

十四 基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1. 本基金管理人为本基金的会计责任人；
2. 本基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日；本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3个月，可以并入下一个会计年度；
3. 本基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
4. 会计制度执行国家有关的会计制度；
5. 本基金独立建账、独立核算；
6. 本基金管理人应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；
7. 本基金托管人与本基金管理人就本基金的基金财产净值、基金份额净值、报表等进行

核对并确认。

(二) 基金审计

1. 基金管理人应聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；

2. 会计师事务所更换经办注册会计师，须事先征得本基金管理人和本基金托管人同意，并报中国证监会备案；

3. 本基金管理人（或本基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经本基金托管人（或本基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所需在 5 个工作日内在中国证监会指定的信息披露报刊上公告。

十五 基金的信息披露

(一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、本基金合同及其他有关规定；

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的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照本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；

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两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，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。

(二) 公开披露的基金信息包括：

1. 基金招募说明书、基金合同、基金托管协议；

本基金募集申请经中国证监会核准后，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报刊和网站上；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。

(1) 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；

本基金合同生效后，基金管理人在每六个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上。

基金管理人在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容

提供书面说明。

(2) 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;

(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。

2. 基金份额发售公告;

基金管理人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报刊和网站上。

3. 基金募集情况;

4. 基金合同生效公告;

基金管理人在本基金合同生效的次日在指定报刊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。

5. 基金份额上市交易公告书;

基金份额获准在证券交易所上市交易时,基金管理人在基金份额上市交易的3个工作日内,将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

6. 基金资产净值、基金份额净值;

本基金合同生效后,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基金份额净值。

T日的基金份额净值在当天收市后计算,精确到0.0001元,小数点后第五位四舍五入,于T+1日公告。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值;基金管理人前款规定的市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

7. 基金份额申购、赎回价格;

基金管理人在本基金合同、本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,并保证基金投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

8. 基金定期报告:包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告;

基金管理人在每年结束之日起90日内,编制完成基金年度报告,并将年度报告正文登

载于网站上,将年度报告摘要登载在指定报刊上;基金年度报告的财务会计报告应当经过审计;

基金管理人在上半年结束之日起 60 日内,编制完成基金半年度报告,并将半年度报告正文登载在网站上,将半年度报告摘要登载在指定报刊上;

基金管理人在每个季度结束之日起 15 个工作日内,编制完成基金季度报告,并将季度报告登载在指定报刊和网站上;

如基金合同生效不足两个月,本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告;

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日,分别报中国证监会和本基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

9. 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两日内编制临时报告书,予以公告,并在公开披露日分别报中国证监会和本基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案;

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;
- (2) 终止本基金合同;
- (3) 转换基金运作方式;
- (4) 更换基金管理人、基金托管人;
- (5) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- (6) 基金管理人股东及其出资比例发生变更;
- (7) 基金募集期延长;
- (8) 基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;
- (9) 基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十;
- (10) 基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十;
- (11) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;

(12)基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;

(13)基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚;

(14)重大关联交易事项;

(15)基金收益分配事项;

(16)管理费、托管费等费用计提标准、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)变更基金份额发售机构;

(20)基金更换注册登记机构;

(21)本基金开始办理申购、赎回;

(22)本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更;

(23)本基金发生巨额赎回并延期支付;

(24)本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;

(25)本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;

(26)中国证监会规定的其他事项。

10. 澄清公告;

在本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、基金上市交易的证券交易所(如有)。

11. 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,应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案,并予以公告;

召开基金份额持有人大会的,召集人应当至少提前30日公告基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项;

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会,本基金管理人、本基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的,召集人应当履行相关信息披露义务。

12. 中国证监会规定的其他信息。

(三) 信息披露事务管理

1. 定期更新的招募说明书公布后,应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所,供公众查阅、复制;

2. 基金定期报告公布后,应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所,以及基金上市交易的证券交易所,供公众查阅、复制;

3. 招募说明书、基金定期报告、基金资产净值公告公布后,投资者可以免费查阅。在支付工本费后可在合理时间获得上述文件的复制件或复印件。基金管理人和基金托管人应保证文本定的内容与所公告的内容完全一致。

十六 风险揭示

(一) 市场风险

本基金主要投资于证券市场,而各种证券的市场价格受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响,导致基金收益的不确定性。

市场风险主要包括:政策风险、利率风险、上市公司经营风险、购买力风险。

(二) 管理风险

1. 因为开放式基金后台运作中的技术因素而产生的风险,如技术系统的故障或者差错产生的风险,这种风险来自基金管理人、基金托管人、注册登记人、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等;

2. 因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险;

3. 因人为因素而产生的风险,如内幕交易、欺诈行为等产生的风险;

4. 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险。

(三) 流动性风险

本基金投资组合的证券可能会因为各种原因使交易的执行难度提高,买入成本或变现成本增加。

(四) 其他风险

1. 因金融市场危机、业务竞争压力可能产生的风险;

2. 战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金财产的损失,影响基金收益水平,从而带来风险;

3. 其他意外导致的风险。

(五) 权证投资风险揭示

基金管理人本着谨慎和风险可控的原则进行权证投资，但仍具有以下风险：

1. 价格风险

由于权证的高杠杆性，权证价格可能会剧烈波动。权证价格与标的证券价格及波动率、利率水平、权证剩余存续期等因素高度相关；同时，权证价格可能会受权证交易活跃程度的影响。权证价格存在因上述因素变化导致的风险：

(1) 标的证券价格及波动率的下降，可能会导致权证价格的下降；

(2) 利率水平的下降，可能会导致权证价格的下降；

(3) 权证剩余存续期的缩短，可能会导致权证价格的下降。

2. 流动性风险

受权证规模及权证交易活跃程度的影响，权证可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。

3. 时效性风险

权证具有一定的存续期，存续期满后权证将不具有任何价值，存在时效性风险。

4. 杠杆风险

由于权证的杠杆效应，权证价格的波动将远远大于其标的股票的波动而带来的风险。

5. 信用风险

在权证持有人行权时，存在发行人无法履约的风险。

十七 基金的终止与清算

(一) 基金合同的终止

出现下列情况之一的，本基金合同经中国证监会批准后将终止：

1. 基金份额持有人大会表决终止的；

2. 因重大违法违规行为，基金合同被中国证监会责令终止的；

3. 基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金的基金管理人，而无其他适当的基金管理机构承接其权利及义务的；

4. 基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金的基金托管人，而无其他适当的基金托管机构承接其权利及义务的；

5. 由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

6. 法律法规或中国证监会允许的其他情况。

(二) 基金财产清算小组

1. 基金合同终止时, 成立基金清算小组, 基金清算小组在中国证监会的监督下进行基金清算。

2. 基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券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。基金清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

(三) 基金财产清算程序

基金合同终止后, 发布基金清算公告

1. 基金合同终止时, 由基金清算小组统一接管基金财产;
2. 对基金财产进行清理和确认;
3. 对基金财产进行估价和变现;
4. 聘请律师事务所出具法律意见书;
5. 聘请会计师事务所对清算报告进行审计;
6. 将基金清算结果报告中国证监会;
7. 参加与基金财产有关的民事诉讼;
8. 公布基金清算公告;
9. 对基金剩余财产进行分配。

(四) 清算费用

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

(五) 基金财产按下列顺序清偿:

1. 支付清算费用;
2. 交纳所欠税款;
3. 清偿基金债务;
4. 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1—3 项规定清偿前, 不分配给基金份额持有人。

(六) 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金清算小

组公告;清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算结果由基金财产清算小组经中国证监会备案后3个工作日内公告。

(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。

十八 基金合同的内容摘要

(一) 基金合同当事人权利及义务

1. 基金管理人的权利与义务

(1) 基金管理人的权利

- ①运用基金财产;
- ②获得基金管理人报酬;
- ③依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
- ④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、非交易过户、转托管等业务的规则;
- ⑤根据本基金合同及有关规定监督基金托管人,对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会和银行业监督管理机构,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;
- ⑥在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回申请;
- ⑦选择、更换注册登记机构,并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;
- ⑧选择、更换销售代理机构,并依据销售代理协议和有关法律法规,对其行为进行必要的监督和检查;
- ⑨在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
- ⑩依法召集基金份额持有人大会;
- ⑪法律法规规定的其他权利。

(2) 基金管理人的义务

- ①依法募集基金,办理或者委托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、勤勉尽责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计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

⑨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;

⑩按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

⑪进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

⑫编制中期和年度基金报告;

⑬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;

⑭保守基金商业秘密,不得泄露基金投资计划、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,不得向他人泄露;

⑮按照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收益;

⑯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;

⑰保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

⑱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者实施其他法律行为;

⑲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;

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,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

㉑基金托管人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托管人追偿;

㉒法律法规规定的其他义务。

2. 基金托管人的权利与义务

(1) 基金托管人的权利

①获得基金托管费;

②监督基金管理人对本基金的投资运作;

③自本基金合同生效之日起, 依法保管基金资产;

④在基金管理人更换时, 提名新任基金管理人;

⑤根据本基金合同及有关规定监督基金管理人, 对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为, 对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形, 应及时呈报中国证监会, 并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;

⑥依法召集基金份额持有人大会;

⑦法律法规规定的其他权利。

(2) 基金托管人的义务

①安全保管基金财产;

②依法接受基金管理人的监督;

③设立专门的基金托管部, 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;

④对所托管的不同基金财产分别设置账户, 确保基金财产的完整与独立;

⑤除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得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;

⑥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;

⑦按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;

⑧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应予保密, 不得向他人泄露;

⑨对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见, 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;

⑩保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

⑪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;

⑫办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;

⑬复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格;

⑭按照规定监督基金管理人的投资运作;

⑮按规定制作相关账册并与基金管理人核对;

⑯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;

⑰按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;

⑱因违反基金合同导致基金财产损失,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

⑲基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金向基金管理人追偿;

⑳法律法规规定的其他义务。

3. 基金份额持有人的权利和义务

(1) 基金份额持有人权利:

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依法转让或者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;

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、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;

⑨法律法规和基金合同规定的其他权利。每份基金份额具有同等的合法权益。

(2) 基金份额持有人的义务:

①遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;

②交纳基金认购、申购款项及规定的费用;

③在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;

④不从事任何有损基金及基金份额持有人合法权益的活动;

⑤执行生效的基金份额持有人大会决议;

⑥返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利;

⑦法律法规和基金合同规定的其他义务。

4. 本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据,不因基金账户名称而有所改变。

(二) 基金份额持有人大会

基金份额持有人大会由基金份额持有人共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

1. 召集事由

(1) 当出现或需要决定下列事由之一的, 经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10% 以上(含 10%, 下同)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)提议时, 应当召开基金份额持有人大会:

- ①终止基金合同;
- ②转换基金运作方式;
- ③变更基金类别;
- ④变更基金投资目标、投资范围或投资策略;
- ⑤变更基金份额持有人大会议事程序;
- ⑥更换基金管理人、基金托管人;
- ⑦提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;
- ⑧本基金与其他基金的合并;
- ⑨法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 出现以下情形之一的, 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、其他应由基金承担的费用;
- ②在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率或收费方式;
- ③因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;
- ④对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;
- ⑤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;
- ⑥按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2. 召集人和召集方式

(1) 除法律法规或本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, 开会时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人选择确定。基金管理人未按规定召集或者不能召集时, 由基金托管人召集。

(2) 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,应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(3) 代表基金份额 10%以上的基金份额持有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。

(4) 代表基金份额 10%以上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,代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会,但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

(5) 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。

3. 议事内容与程序

(1) 议事内容及提案权

① 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

② 基金管理人、基金托管人、单独或合并持权益登记日本基金总份额 10%以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案;也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案,临时提案应当在大会召开日前 40 天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 天公告。

③ 对于基金份额持有人提交的提案(包括临时提案),大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系,并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的,应提交大会审议;对于不符合

上述要求的,不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决,应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决,需征得原提案人同意;原提案人不同意变更的,大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定,并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

④单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,未获基金份额持有人大会审议通过,就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议,其时间间隔不少于 6 个月。

⑤基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后,如果需要对原有提案进行修改,应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则,会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

(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规定程序宣布会议议事程序及注意事项,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,经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权代表主持;如果基金管理人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以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

② 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下,首先由召集人提前 30 天公布提案,在所通知的表决截止日期第 2 天在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

(3) 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。

4. 决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 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

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50%以上通过方为有效，除下列 2) 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

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、提前终止基金合同等重大事项必须以特别决议通过方为有效。

(3) 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准，或者备案，并予以公告。

(4) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(5) 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。

5. 计票

(1) 现场开会

① 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推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，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推举 3 名基金份额持有人担任监票人。

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

③ 如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

(2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，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(如果基金托管人为召集人,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。

十九 基金托管协议的内容摘要

(一) 托管协议当事人

1. 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

办公地址: 北京市西城区锦什坊街 28 号 1-4 层

法定代表人: 杨树财

总经理: 单宇

成立日期: 2004 年 6 月 11 日

注册资本: 壹亿元人民币

经营范围: 基金募集; 基金销售; 资产管理; 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

基金管理公司法人许可证编号: A039

企业法人营业执照注册号: 110000007042263

2. 基金托管人

名称: 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: 董文标

成立日期: 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: 股份有限公司(上市)

注册资本: 22,262,277,489 元人民币

存续期间: 持续经营

电话: 010-58560666

联系人: 关悦

(二) 基金托管人与基金管理人之间的业务监督与核查

1. 基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

(1) 基金托管人根据法律法规和基金合同的规定, 对本基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、所托管的本基金管理人的所有基金的投资比例、基金资产净值的计算、基金管理费和基金托管费的计提和支付等事项进行监督和核查。

(2) 基金托管人发现基金管理人的行为违反法律法规和基金合同的规定, 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工作日前及时核对并以书面形式给基金托管人发出回函, 说明违规原因及纠正期限, 并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内, 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。

(3) 基金托管人发现基金管理人具有重大违规行为, 应及时报告中国证监会, 同时, 通知基金管理人限期纠正, 并将纠正结果报告中国证监会。

2. 基金管理人基金托管人的业务监督、核查

(1) 根据法律法规和基金合同的规定, 基金管理人基金托管人是否及时执行基金管理人合法合规的投资指令、妥善保管基金的全部资产、按时将赎回资金和分红收益划入专用清算账户、对基金资产实行分账管理、擅自动用基金资产等行为进行监督和核查。

(2) 基金管理人发现基金托管人的行为违反法律法规和基金合同的规定, 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在下一工作日前及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函, 说明违规原因及纠正期限, 并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内, 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。

(3) 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为, 应及时报告中国证监会, 同时通知基金托管人限期纠正, 并将纠正结果报告中国证监会。

3. 基金托管人与基金管理人在业务监督、核查中的配合、协助

基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本托管协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或基金托管人无正当理由, 拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权, 或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督, 情节严重或经监督方提出警告仍不改正的, 监督方应报告中国证监会。

(三) 基金财产保管

1. 基金财产保管的原则

(1) 基金托管人应安全保管基金的财产。

(2) 基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户和证券账户, 对所托管的不同基金财

产分别设置账户, 确保基金财产的完整和独立。

(3) 除证券交易清算资金外, 基金托管人未经基金管理人的指令, 不得自行运用、处分、分配基金的任何资产, 如有特殊情况双方可另行协商。

(4) 对于因为基金投资产生的应收资产, 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账户的, 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。

(5) 基金托管人应当设有专门的基金托管部门, 取得基金从业资格的专职人员达到法定人数, 有安全保管基金财产的条件, 有安全高效的清算、交割系统, 有符合要求的营业场所、安全防范设施和与基金托管业务有关的其他设施, 有完善的内部稽核监控制度和风险控制制度。

(6) 除依据法律法规和基金合同的规定外, 基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

2. 基金募集期间及募集资金的验资

(1) 基金募集期间的资金应存于基金管理人在基金托管行的营业机构开立的“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

(2) 基金募集期满或基金停止募集时, 基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户中, 同时在规定时间内, 聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资, 出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

(3) 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。

3. 基金银行账户的开立和管理

(1) 基金托管人可以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户, 并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

(2) 基金银行账户的开立和使用, 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假借本基金的名义开立任何其他银行账户; 亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 基金银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

(4) 在法律法规规定的条件下, 基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金财产

的支付。

4. 基金证券账户的开立和管理

(1) 基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

(2) 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或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。

(3) 基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责, 管理和运用由基金管理人负责。

5. 债券托管专户的开设和管理

(1) 基金合同生效后, 由基金管理人向基金托管人提出申请进入全国银行间同业拆借市场进行交易。基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定, 在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管与结算账户, 并代表基金进行银行间市场债券的结算。

(2) 基金管理人和基金托管人同时代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议, 正本由基金托管人保管, 基金管理人保存副本。

6. 其他账户的开立和管理

(1) 因业务发展需要而开立的其他账户, 可以根据法律法规和基金合同的规定, 由基金托管人负责开立。新账户按有关规则使用并管理。

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的, 从其规定办理。

7. 基金财产投资的有关实物证券的保管

基金财产投资的有关实物证券的保管按照实物证券相关规定办理。

8. 与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管。重大合同包括基金合同、托管协议(及其附件)。

(四) 基金资产净值计算与复核

1. 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数, 基金份额净值的计算, 精确到0.0001元, 小数点后第五位四舍五入, 国家另有规定的, 从其规定。

每工作日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。

2. 复核

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后,将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,由基金管理人对外公布。

(五) 基金份额持有人名册的登记与保管

注册登记机构负责编制和保管基金份额持有人名册。基金合同生效日、基金合同终止日、基金权益登记日、基金份额持有人大会权利登记日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册,由注册登记机构编制。

基金管理人对其对基金份额持有人名册的保管,按国家法律法规及证券监督管理部门的要求执行。

(六) 争议处理和适用法律

因本协议产生或与之相关的争议,双方当事人应通过协商、调解解决,协商、调解不能解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会,仲裁地点为北京市,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。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力。

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,各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本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) 托管协议的修改与终止

本协议双方当事人经协商一致,可以对协议进行修改。修改后的新协议,其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。修改后的新协议,报中国证监会备案后生效,须经证监会批准的,经其批准后生效。

发生以下情况,本托管协议终止:

1. 本基金合同终止;
2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由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、破产或由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。

二十 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。以下是主要的服务内容,基金管

理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化,增加或变更服务项目。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信息的短信确认及网上查询确认服务,投资者可通过接收公司的开户确认短信或者登陆公司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对账单定期发送服务。

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,基金管理人同时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公司网站、客服电话、客服邮箱留下本人的电子邮件地址及相关信息,我们将按投资者的选择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,在这个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;系统同时受理E-Mail 等多样化服务,为客户提供便捷多样的交流方式。

(四) 网上交易业务

本基金已开通网上交易业务,个人投资者可通过本公司网上交易平台办理基金的开户、申购、赎回等各项业务,本公司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,个人投资者通过本公司网上交易平台办理基金申购业务时可享受申购费率优惠,详情可登陆本公司网站 www.orient-fund.com 或 www.df5888.com 查阅本公司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。

(五) 网上查询服务

通过本公司网站,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公司网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

2. 信息资讯服务

客户可以利用公司网站获取基金和公司的各类信息,包括基金的法律文件、业绩报告及公司最新动态等各类最新资料。

(六) 短信服务

本公司已经开通短信服务,通过短信向投资者发送本公司基金、公司活动内容的相关信息。

(七) 资讯服务

投资者如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息,可拨打本公司如下电话:

电话呼叫中心:010-66578578 或 400-628-5888,该电话可转人工座席。

传真:010-66578700

(八) 定期定额投资业务

为方便投资者或基金份额持有人,本基金自2007年12月10日起在中国邮政储蓄银行有限责任公司、2008年1月31日起在兴业银行股份有限公司、3月17日起在招商银行股份有限公司、5月29日起在建设银行股份有限公司和北京银行股份有限公司、7月14日起在民生银行股份有限公司和中信建投证券有限责任公司、10月13日起在海通证券股份有限公司、中信金通证券有限责任公司及兴业证券股份有限公司、10月30日起在广发证券股份有限公司、11月25日起在东北证券股份有限公司、2009年2月9日起在招商证券股份有限公司、2月11日起在中信银行股份有限公司、6月30日起在齐鲁证券有限公司、7月23日起在工商银行股份有限公司、9月8日起在江海证券有限公司、11月20日起在国信证券股份有限公司、2010年1月12日起在广发华福证券有限责任公司、7月7日起在安信证券股份有限公司、2011年5月17日起在中信证券股份有限公司等开始办理定期定额投资业务(前端);通过本公司网上交易平台,于2008年11月7日起开通农行金穗卡、2009年4月3日起开通招行一卡通(借记卡)、8月7日起开通民生银行借记卡、2010年5月21日起开通上海浦东发展银行卡和广东发展银行卡等定期定额投资业务(前端),未来在各项技术条件和准备完备的情况下,将在其它渠道酌情增加本基金的定期定额投资业务。

(九) 基金转换

为方便基金份额持有人,本公司已在直销中心、中国建设银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司等销售渠道开通本基金和本公司管理的其他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) 客户投诉受理服务

投资者可以通过客户服务热线(010-66578578)(400-628-5888)、公司网站(www.orient-fund.com)(www.df5888.com)、电子邮件(services@orient-fund.com)、传真(010-66578700)、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“客户投诉和建议”流程处理,在规定的时间内予以反馈。

(十一) 投资顾问服务

本公司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。

本公司已成立上海分公司,将为华东地区的投资者提供更为周到细致的服务。

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

电子信箱: services@orient-fund.com

二十一 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本基金合同,应召开基金份额持有人大会,对基金合同的修改达成决议。本基金托管人不受《东方基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》的限定。

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

(四) 从上次《招募说明书(更新)》截止日2011年1月11日到本次《招募说明书(更新)》截止日2011年7月11日之间的信息披露事项。

公告名称	发布日期
------	------

本公司关于旗下基金继续参与邮政储蓄银行个人网上申购基金费率优惠活动的公告	2011-1-14
本基金 2010 年第 4 季度报告	2011-1-24
本基金招募说明书更新(2010 年第 2 号)	2011-2-24
本基金招募说明书更新摘要(2010 年第 2 号)	2011-2-24
本公司变更高管人员的公告	2011-3-1
本公司关于公司董事变更的公告	2011-3-10
本公司变更法定代表人的公告	2011-3-10
本公司关于旗下基金继续参与工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	2011-3-30
本基金 2010 年年度报告(摘要)	2011-3-31
本基金 2010 年年度报告(正文)	2011-3-31
本基金 2010 年年度报告更正公告	2011-4-1
本基金 2011 年第 1 季度报告	2011-4-22
本公司迁址公告	2011-5-3
本基金 2010 年年度报告更正公告	2011-5-7
本基金在中信证券开通日常定期定额投资业务公告	2011-5-17
本公司关于旗下基金继续参与交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	2011-6-29
本公司关于旗下基金继续参与中信银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	2011-6-30
本公司旗下基金净值公告	2011-7-1

二十二 招募说明书存放及查阅方式

本《招募说明书》公布后,分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所,供公众查阅、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。

二十三 备查文件

- (一) 中国证监会批准东方精选混合型开放式证券投资基金募集的文件
- (二) 《东方精选混合型开放式证券投资基金基金合同》
- (三) 《东方精选混合型开放式证券投资基金托管协议》
- (四) 《东方精选混合型开放式证券投资基金法律意见书》
- (五) 基金管理人业务资格批件、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

2011年8月24日