东方臻宝纯债债券型证券投资基金招募说明书

基金管理人:东方基金管理有限责任公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司

重要提示

东方臻宝纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据2018年5月24日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予东方臻宝纯债债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2018]849号)准予募集注册。

东方基金管理有限责任公司(以下简称“本基金管理人”)保证《东方臻宝纯债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。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,请认真阅读本招募说明书和基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,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,了解本基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资者的风险承受能力相适应。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。

第一部分 绪言

《东方臻宝纯债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”)依据《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称 “《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称 “《运作办法》”)、《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》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规以及《东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

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

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

第二部分 释义

在《东方臻宝纯债债券型证券投资基金招募说明书》中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1、基金或本基金:指东方臻宝纯债债券型证券投资基金
2、基金管理人:指东方基金管理有限责任公司
3、基金托管人:指中国光大银行股份有限公司
4、基金合同:指《东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《东方臻宝纯债债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6、招募说明书或本招募说明书:指《东方臻宝纯债债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
7、基金份额发售公告:指《东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金份额发售公告》
8、法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
9、《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,2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订,自2013年6月1日起实施并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改(中华人民共和国港口法)等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
10、《销售办法》:指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
11、《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》及颁布机关对其不时做出的修订
12、《运作办法》:指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
13、《流动性风险管理规定》:指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时作出的修订
14、中国证监会:指中国证券监督管理委员会
15、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
16、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
17、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
18、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
19、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办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者
20、投资人、投资者:指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
21、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
22、基金销售业务:指基金管理人或销售机构宣传推介基金,发售基金份额,办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务。
23、销售机构:指东方基金管理有限责任公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议,代为办理基金销售业务的机构
24、登记业务:指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等
25、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为东方基金管理有限责任公司或接受东方基金管理有限责任公司委托代为办理登记业务的机构
26、基金账户:指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
27、基金交易账户:指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户
28、基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期
29、基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
30、基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过3个月
31、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限
32、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
33、T日:指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日
34、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)
35、开放日:指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
36、开放时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
37、《业务规则》:指《东方基金管理有限责任公司开放式基金业务规则》,是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则, 由基金管理人和投资人共同遵守
38、认购:指在基金募集期内,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
39、申购:指基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
40、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
41、基金转换:指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为
42、转托管:指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作
43、定期定额投资计划:指投资人通过有关销售机构提出申请,约定每期申购日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式
44、巨额赎回:指本基金单个开放日,基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的10%
45、A类基金份额:指在投资者认购、申购时收取前端认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额
46、C类基金份额:指从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额
47、元:指人民币元
48、基金收益:指基金投资所得债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约
49、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
50、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值
51、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数
52、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
53、指定媒介: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介
54、不可抗力:指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件
55、流动性受限资产:指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产, 包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等
56、摆动定价机制:指当开放式基金遭遇大额申购赎回时,通过调整基金份额净值的方式, 将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待
1.

第三部分 基金管理人

一、基金管理人基本情况
名称:东方基金管理有限责任公司
住所:北京市西城区锦什坊街28号1-4层
办公地址:北京市西城区锦什坊街28号1-4层
邮政编码:100033
法定代表人:崔伟
成立时间:2004年6月11日
组织形式:有限责任公司
注册资本:叁亿元人民币
营业期限:2004年6月11日至2054年6月10日
经营范围:基金募集;基金销售;资产管理;从事境外证券投资管理业务;中国证监会许可的其他业务
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2004]80号
联系人:李景岩
电话:010-66295888
股权结构:

股东名称	出资金额(人民币)	出资比例
东北证券股份有限公司	19,200万元	64%
河北省国有资产控股运营有限公司	8,100万元	27%
渤海国际信托股份有限公司	2,700万元	9%
合 计	30,000万元	100%

内部组织结构:

股东会是公司的最高权力机构,下设董事会和监事会,董事会下设合规与风险控制委员会、薪酬与考核委员会; 公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制,下设风险控制委员会、投资决策委员会、IT治理委员会、产品委员会和董事会办公室、综合管理部、人力资源部、风险管理部、监察稽核部、财务部、信息技术部、电子商务部、运营部、交易部、权益投资部、研究部、固定收益部、专户投资部、量化投资部、市场部、机构业务一部、机构业务二部、产品开发部、财富管理部二十个职能部门及北京分公司、上海分公司、广州分公司、成都分公司;公司设督察长,分管风险管理部、监察稽核部,负责组织指导公司的风险管理和监察稽核工作。

二、基金管理人主要人员情况

(一)董事会成员

崔伟先生,董事长,经济学博士。历任中国人民银行副主任科员、主任科员、副处级秘书,中国证监会党组秘书、秘书处副处长、处长,中国人民银行东莞中心支行副行长、党委委员,中国人民银行汕头中心支行行长、党委书记兼国家外汇管理局汕头中心支局局长,中国证监会海南监管局副局长兼党委委员、局长兼党委书记,中国证监会协调部副主任兼中国证监会投资者教育办公室召集人; 现任东方基金管理有限责任公司董事长,兼任东北证券股份有限公司副董事长、吉林大学商学院教师、中国证券投资基金业协会监事、东方汇智资产管理有限公司董事长。

张兴志先生,董事,硕士,研究员。历任吉林省经济体制改革委员会宏观处处长,吉林省体改委产业与市场处处长,吉林亚泰(集团)股份有限公司总裁助理、副总裁,东北证券有限责任公司副总裁,东证融达投资有限公司董事、副总经理;现任东北证券股份有限公司副总裁、纪委书记,兼任吉林省证券业协会监事长。

何俊岩先生,董事,硕士,高级会计师、中国注册会计师、中国注册资产评估师,吉林省五一劳动奖章获得者。历任吉林省五金矿产进出口公司计划财务部财务科长,东北证券有限责任公司计划财务部总经理、客户资产管理总部总经理,福建凤竹纺织科技股份有限公司财务总监,东北证券有限责任公司财务总监,东北证券股份有限公司副总裁、常务副总裁,东证融通投资管理有限公司董事,东证融达投资有限公司董事,东方基金管理有限责任公司监事会主席;现任东北证券股份有限公司副董事长、总裁、党委副书记,吉林省总会计师协会副会长,东证融通投资管理有限公司董事长, 东证融达投资有限公司董事, 东证融汇证券资产管理有限公司董事。

庄立明先生,董事,大学学历,会计师。历任河北省商业厅审计处,河北华联商厦分店副经理,省贸易厅财审处,省商贸集团财审处(正科),省工贸资产经营有限公司财务监督处副处长,河北省国有资产控股运营有限公司财务监督部副部长、财务监督部部长、副总会计师;现任河北省国有资产控股运营有限公司董事、总会计师,兼任财达证券有限责任公司董事,华联发展集团有限公司董事。

董丁丁先生,董事,北京大学金融学硕士,中共党员。历任海南航空股份有限公司飞行计划员、机组资源管理员、海航集团财务有限公司金融服务部信贷信息助理、信贷信息主管、公司业务经理、客户经理、总经理助理,资金信贷部副总经理、总经理。现任渤海国际信托股份有限公司财务总监。

雷小玲女士,独立董事,北京大学EMBA,中国注册会计师。历任贵阳市财经学校会计专业教师, 贵州省财经学院会计学系教师, 海南会计师事务所注册会计师,证监会发行部发行审核委员,亚太中汇会计师事务所有限公司副主任会计师。现任中审众环会计师事务所海南分所所长, 兼任海南省注册会计师协会专业技术咨询委员会主任委员。

陈守东先生,独立董事,经济学博士。历任通化煤矿学院教师,吉林大学数学系教师,吉林大学经济管理学院副教授,吉林大学商学院教授、博士生导师;现任吉林大学数量经济研究中心教授、博士生导师, 兼任通化葡萄酒股份有限公司独立董事,中国金融学年会常务理事,吉林省现场统计学会副理事长,吉林省法学会金融法学会副会长及金融法律专家团专家。

刘峰先生,独立董事,大学本科。历任湖北省黄石市律师事务所副主任,海南方圆律师事务所主任;现任上海市锦天城律师事务所高级合伙人,兼任梓昆科技(中国)股份有限公司独立董事,三角轮胎股份有限公司独立董事,中华全国律师协会律师发展战略研究委员会副主任,金融证券委员会委员,中国国际经济,科技法律学会理事, 并被国家食品药品监督管理总局聘为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。曾任吉林物资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。

(二)监事会成员

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

杨晓燕女士,监事,硕士研究生,高级经济师。曾任职北京银行等金融机构,20余年金融、证券从业经历;现任东方基金管理有限责任公司风险管理部总经理,兼任监察稽核部总经理。

肖向辉先生,监事,本科。曾任职北京市化学工业研究院、中国工商银行总行;现任东方基金管理有限责任公司运营部总经理。

(三)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,简历请参见董事介绍。

秦熠群先生,副总经理,兼任东方汇智资产管理有限公司董事,中央财经大学经济学博士。历任中央财经大学经济学院副院长、学校分部副主任等职务。2011年7月加盟本公司,历任董办主任、董秘、总经理助理等职务,期间兼任人力资源部、综合管理部、风险管理部等部门总经理职务。

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

(四)本基金基金经理

彭成军先生,公司总经理助理,固定收益投资总监,投资决策委员会委员,清华大学数学硕士,11年投资从业经历。曾任中国光大银行交易员,中国民生银行金融市场部投资管理中心总经理助理、高级交易员。2017年11月加盟东方基金管理有限责任公司。现任东方双债添利债券型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理。

(五)投资决策委员会成员

刘鸿鹏先生,总经理,投资决策委员会主任委员,简历请参见董事介绍。

许文波先生,公司总经理助理,权益投资总监,投资决策委员会委员。吉林大学工商管理硕士。曾任新华证券有限责任公司投资顾问部分析师;东北证券股份有限公司资产管理分公司投资管理部投资经理、部门经理;德邦基金管理有限公司基金经理、投资研究部总经理。2018年4月加盟东方基金管理有限责任公司。

彭成军先生,简历请参见基金经理介绍。

蒋茜先生,权益投资部总经理,投资决策委员会委员。清华大学工商管理硕士,8年证券从业经历。历任GCW Consulting高级分析师、中信证券高级经理、天安财产保险股份有限公司研究总监、渤海人寿保险股份有限公司投资总监。2017年5月加盟东方基金管理有限责任公司。现任东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理。

刘志刚先生,量化投资部总经理,投资决策委员会委员,吉林大学数量经济学博士,10年基金从业经历。曾任工银瑞信基金管理有限公司产品开发部产品开发经理、安信基金管理有限责任公司市场部副总经理兼产品开发总监。2013年5月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任指数与量化投资部总经理、专户业务部总经理、产品开发部总经理、投资经理、东方央视财经50指数增强型证券投资基金(自2015年12月3日起转型为东方启明量化先锋混合型证券投资基金)基金经理。现任东方启明量化先锋混合型证券投资基金基金经理、东方鼎新灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、东方量化成长灵活配置混合型证券投资基金。

王然女士,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,10年证券从业经历,曾任益民基金交通运输、纺织服装、轻工制造行业研究员。2010年4月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究员,东方策略成长股票型开放式证券投资基金(于2015年8月7日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金)基金经理助理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金(于2015年8月7日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金)基金经理、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金 (于2017年5月11日转型为东方成长收益平衡混合型基金)基金经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金 (于2017年9月13日起转型为东方民丰回报赢安混合型证券投资基金)基金经理、东方成长收益平衡混合型证券投资基金(于2018年1月17日转型为东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金)基金经理、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方岳灵活配置混合型证券投资基金基金经理,现任东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方金元宝货币市场基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理。

(六)上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人职责

(一)基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:

1、依法募集资金;
2、自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;
3、依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;
4、销售基金份额;
5、按照规定召集基金份额持有人大会;
6、依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
7、在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
8、选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;
9、担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用;

(下转A38版)

东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人:东方基金管理有限责任公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司

重要提示

一、东方臻宝纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]849号文准予募集注册。中国证监会对本基金的注册并不代表中国证监会对本基金的风险和收益做出实质性判断、推荐或保证。

二、本基金的基金类型为债券型基金,本基金的运作方式为契约型、开放式。

三、本基金管理人为东方基金管理有限责任公司(以下简称“本公司”),基金托管人为中国光大银行股份有限公司(以下简称:“中国光大银行”),登记机构为本公司。

四、本基金仅在直销机构发售,暂无其他销售机构。

本基金管理人可根据有关法律法规的要求, 选择符合要求的销售机构销售本基金,并将及时公告。

五、本基金自2018年7月30日至2018年8月31日通过基金销售机构公开发售,本基金的募集期限不超过3个月,自基金份额开始发售之日起计算。本公司也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。

六、本基金募集对象为个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买本基金的其他投资者。个人投资者指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人; 机构投资者指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织;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办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者。

七、本基金募集份额总额不少于2亿份,募集金额不少于2亿元。

八、投资者欲购买本基金,需开立本公司基金账户。除法律法规另有规定外,每个投资者仅允许开立一个本公司基金账户, 已经开立本公司基金账户的投资者无须重复开户。投资者在办理完开户和认购手续后,应及时查询确认结果。

九、投资者认购本基金份额时,需按销售机构规定的方式全额交付认购款项,投资者可以多次认购本基金份额。投资者在销售机构首次认购本基金的最低认购金额为1.00元人民币,追加认购的最低金额为1.00元,累计认购金额不设上限。当日的认购申请在销售机构规定的时间之后不得撤销。

十、投资者有效认购款项在基金募集期间形成的利息归投资者所有,如基金合同生效,则折算为基金份额计入投资者的账户,具体份额以登记机构的记录为准。

十一、如果基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致单一投资者持有基金份额比例达到或超过50%, 或者有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的情形时,基金管理人有权对该单一投资者的全部或部分申请确认失败,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动超标的除外。

十二、投资人在募集期内可多次认购,但已受理的认购申请不允许撤销。

十三、基金销售机构对申请的受理并不表示对该申请的成功确认,而仅代表销售机构确实接受了认购申请,申请的成功确认应以基金登记机构的确认登记为准。投资者可在基金合同生效后到销售机构查询最终成交确认情况和认购的份额。

十四、本公告仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读刊登在2018年7月27日《中国证券报》上的《东方臻宝纯债债券型证券投资基金招募说明书》和《东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金合同内容摘要》。本基金的基金合同、托管协议、招募说明书及本公告将同时在本公司网站发布。投资人亦可通过本公司网站下载基金业务申请表格、了解本基金发售的相关事宜。

十五、本基金的销售机构为直销机构,包括本公司的直销柜台和网上直销。本基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他的销售机构,并将及时公告。各销售机构的业务办理网点、办理日期和时间等事项参照各销售机构的具体规定。

十六、投资者如有任何问题, 可拨打本公司客户服务电话400-628-5888咨询,也可拨打其他销售机构的客服热线咨询认购事宜。

十七、本基金管理人可综合各种情况对募集安排做适当调整。

十八、风险提示

证券投资基金(以下简称“基金”)是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资人购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险, 既包括市场风险以及债券价格波动风险,也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险, 即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时,投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型,投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期,也将承担不同程度的风险。一般来说,基金的收益预期越高,投资人承担的风险也越大。

本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于股票型和混合型基金。

本基金对固定收益类资产的投资中将资产支持证券纳入到投资范围当中,可能带来以下风险:

(一)信用风险:基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约,或在交易过程中发生交收违约,或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降,造成基金财产损失。

(二)利率风险:市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格的变动,一般而言,如果市场利率上升,本基金持有资产支持证券将面临价格下降、本金损失的风险,而如果市场利率下降,资产支持证券利息的再投资收益将面临下降的风险。

(三)流动性风险:受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响,资产支持证券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。

(四)提前偿付风险:债务人可能会由于利率变化等原因进行提前偿付,从而使基金资产面临再投资风险。

(五)操作风险:基金相关当事人在业务各环节操作过程中,因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险,例如,越权违规交易、交易错误、IT系统故障等风险。

(六)法律风险:由于法律法规方面的原因,某些市场行为受到限制或合同不能正常执行,导致基金财产的损失。

本基金在投资中将国债期货纳入到投资范围中,因此,可能面临市场风险、基差风险、流动性风险等。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是指由于期货与现货间的价差的波动,影响套期保值或套利效果,使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类:一类为流通量风险,是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险, 此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的;另一类为资金量风险,是指资金量无法满足保证金要求,使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

本基金的流动性风险评估及相关措施如下:

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

(一)本基金申购、赎回安排

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

除了上述申购、赎回安排外,本基金拟针对大额申购及巨额赎回两个方面做好预防基金流动性风险的准备措施。

1、大额申购

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

若接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%,或者变相规避50%集中度的情形时,本基金管理人将拒绝超出比例的申购申请。

2、巨额赎回

在单个开放日,若基金净赎回申请超过上一开放日基金总份额的10%时,即认为发生了巨额赎回。当基金出现巨额赎回时,本基金管理人将根据基金的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

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

如果基金发生巨额赎回, 对于单个基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额20%以上的赎回申请,可以进行延期办理。对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分,基金管理人根据实际情况进行“全额赎回”或“部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。

(二)投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金为纯债型基金,仅投资于具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

上述资产均存在规范的交易场所,运作方式规范透明,从市场历史数据来看,具备良好的流动性。本基金将针对各类投资标的的流动性特点进行分散投资,严格按照相关法律法规的要求,及时调整7个工作日内可变现资产的配置情况,确保投资资产处于较高的流动性。当基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值不足支付当日净赎回申请所需资金时, 本基金管理人有权按比例拒绝基金份额持有人的赎回申请。

(三)巨额赎回下的流动性风险管理措施

当本基金发生巨额赎回情形时, 基金管理人可以采用以下流动性风险管理措施:

1、延期办理巨额赎回申请;
2、暂停接受赎回申请;
3、延缓支付赎回款项;
4、摆动定价;
5、中国证监会认定的其他措施。

(四)实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响:

基金管理人经与基金托管人协商,在确保投资者得到公平对待的前提下,可依照法律法规及基金合同的约定,综合运用各类流动性风险管理工具,对赎回申请等进行适度调整,作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施,包括但不限于:

1、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时, 经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。在此情形下,基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

2、如果基金发生巨额赎回,对于单个基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额20%以上的赎回申请,可以进行延期办理。具体措施请见基金合同及招募说明书中“基金份额的申购与赎回”部分“巨额赎回的处理方式”。因此在巨额赎回情形发生时,基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

3、持有人提出赎回申请时, 本基金对持有期少于7日的投资者收取不低于1.50%的赎回费并全额计入基金财产。

4、当本基金发生大额申购或赎回情形时,本基金管理人可以采用摆动定价机制,以确保基金估值的公平性。当日参与申购和赎回交易的投资者存在承担申购或者赎回产生的交易及其他成本的风险。

投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件,遵循基金投资“买者自负”的原则,全面认识产品风险收益特征和产品特征,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场和基金的投资价值,在对认购、申购基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立、谨慎决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险,不能保证投资人获得收益,也不是替代储蓄的等效理财方式。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负担。

投资人应当通过基金管理人或具有基金代销业务资格的其他机构购买和赎回基金,基金代销机构名单详见本发售公告、本基金《招募说明书》以及相关公告。

十九、本基金管理人拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

一、本次基金募集的基本情况

1、基金名称:东方臻宝纯债债券型证券投资基金
2、基金简称及代码
基金简称:东方臻宝纯债债券A,基金代码:006210
基金简称:东方臻宝纯债债券C,基金代码:006211
3、基金类别:债券型基金
4、基金运作方式:契约型、开放式
5、基金存续期限:不定期
6、基金初始份额面值:1.00元人民币
7、募集方式:本基金通过销售机构向投资者公开发售。除法律法规另有规定外,任何与基金份额发售有关的当事人不得预留和提前发售基金份额。
8、募集对象:符合法律法规规定个