东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2018年第2号）

基金管理人：东兴证券股份有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
二零一八年十月

重要提示

东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（简称“本基金”）于2016年8月2日经中国证券监督管理委员会证监许可【2016】1744号文注册募集。

基金管理人保证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。投资者认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

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，本基金在投资运作过程中可能面临各种风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等。

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换公司债等)、债券回购、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、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金产品的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核，基金管理人股权结构数据截止日为2018年09月30日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年09月30日，本招募说明书其他所载内容截止日为2018年10月27日。

一、基金合同生效日期

2016年8月2日

二、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：东兴证券股份有限公司
成立日期：2008年5月28日
注册地址：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）12、15层
法定代表人：魏庆华
组织形式：股份有限公司
联系人：陈智勇
联系电话：010-57307309
传真：010-57307388
注册资本：275796.0657万元人民币
股权结构：（截止2018年9月末）

序号	股东名称	持股数量（股）	持股比例（%）
1	中国东方资产管理股份有限公司	1,454,600,484	52.74
2	山东高速股份有限公司	119,989,367	4.35
3	中国证券金融股份有限公司	82,463,160	2.99
4	福建天宝矿业集团股份有限公司	61,530,568	2.23
5	上海工业投资（集团）有限公司	55,159,200	2.00

（二）主要人员情况

1、董事会成员

魏庆华先生，1964年10月出生，博士研究生学历，高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于福建清流县外贸局；曾任清流县人民银行股长、副行长；三明市人民银行办公室副主任（主持工作）；闽发证券三明支公司总经理、闽发证券副总裁、总裁，东兴证券副总经理。现任东兴证券董事长、总经理、财务负责人，东兴证券投资有限公司董事长。

谭世豪先生，1964年1月出生，硕士研究生，高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国银行股份有限公司国际业务部科员、主任科员、副处长、处长，中国东方资产管理股份有限公司（以下简称“中国东方”）股权及投行部经理、助理总经理、资产经营部副总经理，邦信资产管理有限公司副总经理，中国东方人力资源部副总经理。现任东兴证券副董事长，东兴证券（香港）金融控股有限公司董事长。

秦斌先生，1968年4月出生，博士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。1998年起任职于中国银行海外行管理部，2000年起任职于中国东方资产管理公司股权及投行业务部、市场开发部、总裁办公室，2005年起历任中国东方总裁办公室助理总经理、副总经理，研发中心副总理（主持工作）、总经理，2013年1月至今任中国东方战略发展规划部总经理。2016年1月至今任东兴证券董事。

江月明先生，1971年8月出生，硕士研究生学历，持有中国律师执业资格证书，中国国籍，无境外永久居留权。2001年7月至2016年8月历任中国东方经营处置审查办公室副经理、重庆办事处风险管理部经理、重庆办事处业务部经理、重庆办事处助理总经理兼党委委员、武汉办事处助理总经理兼党委委员、重庆办事处副总经理兼党委委员、重庆市分公司副总经理兼党委委员，法律合规部副总经理（主持工作）。2017年 12月至今任中国东方法律合规部总经理，兼任浙江融达企业管理有限公司董事。2017年6月至今任东兴证券董事。

屠波旋先生，1973年8月出生，大学本科，经济师。屠波旋先生曾就职于中国银行上海市分行、中国东方上海办事处，上海大盛资产有限公司；曾任上海国盛（集团）有限公司资产管理中心副主任、上海国盛资产经营部总经理、总裁助理；现任上海国盛集团资产有限公司副总裁，上海盛瀚投资有限公司执行董事，上海正浩资产管理有限公司董事长，湖南外商国际活动中心有限公司董事长，湖南青竹湖活力养老社区实业有限公司董事长。2007年8月至今任东兴证券董事。

王云泉，男，1969年3月出生，硕士研究生，高级经济师、会计师。曾就职于山东省交通厅人事处、山东省交通开发投资公司办公室、山东基建股份有限公司。2006年12月至今，历任山东高速股份有限公司总经理助理、副总经理。2007年4月至2015年6月，兼任山东高速股份有限公司第三届、第四届董事会秘书；2009年6月至2015年8月，兼任山东高速股份有限公司总法律顾问；2011年1月至今，任山东高速股份有限公司董事；2017年7月至今，兼任山东高速股份有限公司第五届董事会秘书；2013年9月至今，兼任山东高速投资发展有限公司董事长；2017 年 12 月至今，兼任山东高速（深圳）投资有限公司董事长（法定代表人）。2018年6月至今任东兴证券董事。

郑振龙先生，1966年3月出生，博士研究生，厦门大学管理学院教授，中国国籍，无境外永久居留权。曾任厦门大学研究生院副院长、经济学院副院长、金融系副主任（主持工作）。现任厦门大学闽江学者特聘教授、国务院学位委员会学科评议组成员，享受国务院政府特殊津贴，兼任华福证券独立董事，厦门国际银行股份有限公司独立董事、福建华通银行独立董事。2017年3月至今任东兴证券独立董事。

张伟先生，1977年4月出生，博士研究生，具有FRM（金融风险管理师）资格。2001年8月至2012年2月，历任中国人民银行研究生部教研部研究实习员、副主任兼助理研究员；中国人民银行研究生部行政部副主任兼副研究员。2012年3月至今任清华大学五道口金融学院校友办主任兼副研究员。主要从事宏观经济、货币政策、汇率体制、股票投资、外汇投资、金融稳定机制、金融危机预警机制等方面研究。2017年3月起任东兴证券独立董事。

宫肃康先生，1965年3月出生，硕士研究生学历，注册会计师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中央财政金融学院税务系教师、北京市新技术产业开发试验区财政审计所专管员。现任北京天平会计师事务所有限责任公司执行董事总经理、北京天平健税务师事务所执行董事总经理。2017年12月至今任东兴证券独立董事。

孙广亮先生，1963年7月出生，本科学历，律师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国法律事务中心律师、众鑫律师事务所律师，现任北京市华堂律师事务所合伙人律师、主任，大商股份有限公司独立董事、大恒新纪元科技股份有限公司独立董事。2017年12月至今任东兴证券独立董事。

2、监事会成员

许向阳先生，1965年7月出生，本科学历，律师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国政法大学讲师，国家经济体制改革委员会政策法规司副处长、处长，中国银行股份有限公司法律部处长，中国东方资产管理公司总裁办公室、资产处置审查办公室副总经理，哈尔滨办事处、法律事务部、机构管理部总经理。2011年7月至今任东兴证券监事会主席。

叶淑玉女士，1957年5月生，物理学学士、中欧EMBA，高级工程师、会计师。曾任福州无线电七厂质检科副科长兼厂团总支书记；福州电子工业局团委委员；福州智达电脑品管部副经理；福建新世纪电脑集团有限公司副总裁；实达电脑集团人力资源处处长、监事；实达电脑与美国Compaq合资公司副总经理；上海外高桥房地产有限公司副总经理。现任东煌企业集团董事局主席助理，福建天东煌集团股份有限公司董事，福建天宝矿业集团股份有限公司董事、副总裁兼董事会秘书。2017年3月至今任东兴证券监事。

罗小平先生，1960年5月出生，硕士研究生，高级经济师。曾任中国远洋天津远洋运输公司轮机员、中国海员对外技术服务公司驻香港代表处代表；华夏证券股份有限公司投行部副总经理、并购部和证券营业部总经理、中华企业咨询有限公司执行总裁；中国诚通控股集团有限公司战略发展中心总监。现任中国诚通控股集团有限公司专职派出董事、中国物流有限公司董事、中国诚通香港有限公司董事。2011年11月至今任东兴证券监事。

郝洁女士，1971年4月出生，硕士研究生，中国国籍，无境外永久居留权。曾任信达资产管理公司财务部会计，宏源证券股份有限公司财务部总经理助理、副总经理，现任东兴证券财务部总经理，兼任东兴证券投资有限公司董事、东兴期货有限责任公司董事。2017年3月至今任东兴证券职工监事。

杜彬先生，1973年2月出生，本科学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于中国人民银行；曾任中国民族国际信托投资公司国际业务部副经理、资产管理部总经理，中国民族证券有限责任公司法律及合规政策部经理，合规部副总经理、总经理，合规部兼风险管理部总经理，合规风控部总经理；现任东兴证券合规法律部总经理、东兴证券投资有限公司董事、东兴资本投资管理有限公司监事、东兴期货有限责任公司监事、上海东策盛资产管理有限公司监事。2014年8月至今任东兴证券职工监事。

3、总经理及其他高级管理人员

魏庆华先生和谭世豪先生，简历请参见上述关于董事的介绍

许学礼先生，1963年12月出生，博士研究生学历，高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任财政部财政科学研究所助理研究员；中国南山开发公司上市小组成员；深圳证券交易所高级研究员；广州尊荣集团副总经理；深圳汉君雄投资公司副总经理；亚洲控股有限公司总裁助理；大通证券股份有限公司副总经理；东兴证券首席风险官。现任东兴证券副总经理兼合规总监，东兴证券（香港）金融控股有限公司董事。

银国宏先生，1974年3月出生，博士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国教育科技信托投资公司证券营业部研究咨询部经理；中信建投证券有限责任公司研究所所长助理；东兴证券研究所总经理，公司助理总经理兼研究所、机构业务部总经理、资产管理业务总部总经理、基金业务部总经理。现任东兴证券副总经理，衍生品部总经理，东兴期货有限责任公司董事长，东兴财富资产管理有限公司董事长。

张军先生，1975年5月出生，硕士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任北京市园林局香山公园科员；中诚信托投资有限责任公司信托经理；中国证券监督管理委员会发行监管部审核一处科员、副调研员、副处长。2015年9月至今任东兴证券首席风险官，2018年8月至今任东兴证券副总经理，现兼任东兴证券（香港）金融控股有限公司董事。

刘亮先生，1974年10月出生，本科学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于福建省政府办公厅证券办；中国证监会福建特派员办事处，福建监管局主任科员、副处长、处长；东兴证券助理总经理、总经理办公室总经理、场外市场业务总部总经理、新疆分公司总经理；东兴证券董事会秘书、董事会办公室总经理。2016年11月任东兴证券副总经理兼董事会秘书，现兼任福建分公司总经理。

陈海先生，1970年12月出生，本科学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任闽发证券深圳营业部会计主管，闽发直属营业部分析师，总部信息研究中心股评部经理，北环东路证券营业部助理总经理；东兴证券北环东路营业部助理总经理、营销总监，福州五一中路营业部江厝服务部负责人，福州江厝营业部总经理、福建分公司副总经理，公司助理总经理、资产管理业务总部业务一部总经理、资产管理业务总部总经理。现任东兴证券副总经理，东兴证券（香港）有限公司董事。

张锋先生，1973年12月出生，硕士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国银行总行营业部出口处职员；中国东方资产管理公司股权部、实业部、评估部助理经理、副经理；东兴证券股份有限公司北京北四环中路证券营业部负责人、总经理、企业融资部总经理、财富管理部总经理。2018年8月至今任东兴证券董事会秘书，现兼任助理总经理和机构客户部总经理。

4、合规总监

许学礼先生，简历请参见上述关于总经理及其他高级管理人员的介绍。

5、本基金基金经理

李兵伟先生，中央财经大学金融学硕士，8年证券行业经验，具有基金从业资格。2010年开始从事证券行业工作，2010年7月至2015年8月，任信达证券金融工程研究员、投资经理；2015年9月加入东兴证券基金业务部。具有多年量化投研经验，对量化选股和量化择时有深刻的体会和执行经验。

程远，北京工商大学金融工程专业毕业，具有9年证券行业从业经验。2008年进入东兴证券投资银行总部工作，2009年任东兴证券研究所纺织服装行业高级研究员，2011年任华泰证券（原华泰联合）研究所纺织服装研究组组长，2013年任华泰证券纺织服装组组长兼任轻工造纸组和旅游酒店组组长，2015年任东兴证券基金业务部研究总监。

6、基金业务投资决策委员会成员

银国宏先生，简历请参见上述关于经营管理层人员的介绍
王青女士，现任基金业务部总经理。
程远先生，现任基金业务部投资总监，兼任研究总监、基金经理。
孙继青先生，现任基金业务部基金经理。
李晨辉先生，现任基金业务部基金经理。
7、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：中国工商银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：易会满
成立日期：1984年1月1日
批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）
基金托管业务批准文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3号
注册资本：35,640,625.71万元人民币
存续期间：持续经营
联系电话：010-66105799
联系人：郭明

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2018年6月，中国工商银行共托管证券投资基金874只。自2003 年以来，本行连续十五年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的61项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

2、主要人员情况

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

3、基金托管业务经营情况

截至2018年6月，中国工商银行共托管证券投资基金874只。

（二）基金托管人的内部控制制度说明

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的ISAE3402审阅，获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

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

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

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

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

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

4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

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

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

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

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

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

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

5、资产托管部内部风险控制情况

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

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

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

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

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

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人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有重大违规行为，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）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）东兴证券股份有限公司直销中心
a、东兴证券股份有限公司网上直销系统
交易系统网址：https://tradefund.dxzq.net/etrading/
b、东兴证券股份有限公司直销柜台
办公地址：北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层
联系人：陈智勇
直销中心电话：010-57307309
传真：010-57307388
公司网站：http://www.dxzq.net

（2）东兴证券股份有限公司分支机构
住所：北京西城区金融大街5号新盛大厦B 座6层
办公地址：北京西城区金融大街5号新盛大厦B座6层
法人代表：魏庆华
联系人：田丰舞
传真：010-57307388

2、代销机构

（1）中国工商银行股份有限公司
注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街55号
客服电话：95588
公司网站：http://www.icbc.com.cn/ICBC/default.htm

（2）大连银行股份有限公司
注册地址：辽宁省大连市中山区中山路 88 号
客服电话：400-664-0099
公司网站：http://www.bankofdl.com

（3）上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
客服电话：4009918918 / 4001818188
公司网址：www.1234657.com.cn

（4）上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号
客服电话：400-700-9665
公司网站：www.ehowbuy.com

（5）上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
客服电话：400-820-2899
公司网站：http://www.erichfund.com/

（6）北京展恒基金销售股份有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号
客服电话：400-818-8000
公司网站：www.myfund.com

（7）上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室
客服电话：400-921-7755
公司网站：www.leadbank.com.cn

（8）乾道金融信息服务（北京）有限公司
注册地址：北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室
客服电话：400-088-8080
公司网站：www.qiandaojr.com

（9）北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室
客服电话：4007-868-868
公司网站：www.chtfund.com

（10）北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号
客服电话：400-068-1176
公司网站：www.fundzone.cn

（11）北京钱景基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012
客服电话：400-893-6885
公司网站：www.qianjing.com

（12）北京新浪仓石基金销售有限公司
地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区8号楼新浪总部大厦
客服电话：86-10-62675369
公司网站：https://trade.xincai.com/web/promote

（13）万得信息技术股份有限公司
地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦
客服电话：400-820-9463
公司网址：http://www.wind.com.cn/Default.aspx

（14）上海基煜基金销售有限公司
地址：上海市昆明路518号北美广场A1002-A1003室
客服电话：400-820-5369
公司网址：https://www.jiyufund.com.cn/login

（15）大泰金石基金销售有限公司
注册地址：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
客服电话：400-928-2266
公司网站：http://www.dtfunds.com

（16）北京肯特瑞财富投资管理有限公司
地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
客服电话：400 088 8816
公司网站：http://kenterui.jd.com/kenTeRui.html

（17）联讯证券股份有限公司
注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
客服电话：95564
公司网站：www.lxzq.com.cn

（18）金惠家保险代理有限公司
公司网站：www.jhjhome.net
客服热线：400-8557-333

（19）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
公司网站：https://www.antfortune.com/
客服热线：95188

（20）南京苏宁基金销售有限公司
公司网站：https://www.snjijin.com/
客服热线：95177

(21) 深圳众禄基金销售股份有限公司
公司网站：http://www.jjmmw.com/
客服热线：4006-788-887

(22) 济安财富（北京）基金销售有限公司
公司网站：http://www.jianfortune.com/
客服热线：400-673-7010

(23) 北京植信基金销售有限公司
公司网站：https://www.zhixin-iv.com/
客服热线：4006-802-123

（24）上海联泰资产管理有限公司
公司网站：http://www.66liantai.com/
客服热线：400-166-6788

（25）珠海盈米财富管理有限公司
公司网站：https://www.yingmi.cn/

（26）嘉实财富管理有限公司
公司网站：https://www.harvestwm.cn/
客服热线：400-021-8850

（27）北京加和基金销售有限公司
公司网站：www.bzfunds.com
电话：010-50866175

（28）上海陆金所基金销售有限公司
公司网站：http://www.lufunds.com/
客服热线：400-8219-031

（29）大连网金基金销售有限公司
公司网站：http://www.yibaijin.com/
客服热线：4000-899-100

（30）北京蛋卷基金销售有限公司
公司网站：https://danjuanapp.com/
客服热线：4000-618-518

（31）天津万家财富资产管理有限公司
公司网站：http://www.wanjiawealth.com/
客服热线：010-59013895

（二）登记机构

名称：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
法定代表人：魏庆华
办公地址：北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层
联系人：王广辉
电话：010-57307359
传真：010-57307366

（三）律师事务所

名 称：北京市天元律师事务所
住所：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
负责人：朱小辉
电话：010-57763888
传真：010-57763777
经办律师：吴冠雄、李晗

（四）会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城西二办公楼8层10室
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城西二办公楼8层10室
执行事务合伙人：崔劲
联系电话：010-85207108
传真：010-85181218
经办注册会计师：李燕、李瑶帆

五、基金名称和基金类型

（一）本基金名称：东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金
（二）本基金类型：混合型
运作方式：契约型开放式

六、基金的投资目标和投资方向

（一）投资目标

本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

（二）投资理念

本基金通过数量化投资分析手段，从多个角度对股票进行系统化分析研究，识别市场价值低估的机会，在既定风险水平下最大限度提高投资收益，尽可能提高基金夏普比率。

（三）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换公司债券等)、债券回购、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、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，每个交易日日终现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

七、基金的投资策略

本基金采用量化方法进行投资，通过量化分析手段甄选多种有效的投资策略，在投资过程中最大限度消除人为情绪波动对投资造成的扰动。通过多种量化策略的组合搭配以达到获取稳定Alpha组合并进行择时判断的效果，降低系统性及非系统性风险。

1、资产配置策略

本基金通过提取宏观经济、市场趋势、微观主体的关键量化指标并运用数量化模型进行客观分析，结合美林投资时钟理论，综合考虑本基金投资目标、风控要求等因素，合理确定在股票市场、债券市场、货币市场的配置比例，并不断进行动态管理。

2、股票投资策略

本基金采用多种量化策略进行股票投资，主要策略包括多因子选股策略、事件投资策略、舆情监控投资策略、行业量化配置策略等。在不同的市场情况下，通过选择不同的策略或多种策略的互相搭配构建投资组合。同时，基金管理人量化投资团队将不断进行更有效策略的开发和测试，不断增强投资业绩。

（1）多因子选股策略

多因子选股为市场上运用较多的选股方法，本基金通过对影响股票价格因素的分析，形成八大类别的因子库，包括成长类因子、营运类因子、资本结构类因子、盈利能力因子、金融行业因子、估值因子、一致预期因子、市场类因子。在完善以上因子库的基础上，将所有上市公司按申万一级行业分类并针对每个行业进行动态的因子分析和回归分析，确定每个行业最有效的因子的基础上筛选最有可能跑赢市场的股票组合。

多因子选股策略的所有数据均来自股票市场公开数据，包括上市公司定期公布的财务数据、上市公司基本资料、场内市场公开交易数据等。所有未经权威渠道披露的数据均不作为多因子选股策略的数据依据。

（2）事件投资策略

资本市场的发展壮大和对资本市场有冲击效应的事件发生得越来越频繁，事件性投资机会层出不穷。影响股票价格变动的事件通常有增发、收购兼并、资产注入、整体上市、发行可转债、上市公司业绩公告等；对相关行业的影响事件通常有利率政策、行业政策、汇率政策、突发事件等；对商品市场的影响事件通常有地缘冲突、罢工事件、政策收储、公布重要经济数据、利率政策、货币政策等；对债券的影响事件通常有利率政策、货币政策、重要经济数据。通常这类事件都会短暂打破市场均衡价格，通过对历史数据的定量和定性分析，可以在预期发生的前后买入相关投资标的。

事件选股涉及的数据包括定增预案日期、公告日期、增发日期、业绩快报数据、业绩预告数据、股权激励预案日期、并购事件披露日期、利率准备金率调整幅度及调整公布日期等。所有涉及到数据均来自于上市公司公开公共内容及相关货币当局、统计局等。

（3）舆情监控投资策略

所谓舆情监控，是指整合互联网信息采集技术及信息智能处理技术，通过对互联网海量信息自动抓取、自动分类聚类、主题检测、专题聚焦，实现用户的网络舆情监测和新闻专题追踪等信息需求，形成简报、报告、图表等分析结果，提供分析依据。

具体到舆情监控投资策略，主要对互联网涉及到股票相关的文章、评论进行语义分析，对市场主体投资情绪进行客观描述，在市场情绪过热时主动回避，避免泡沫化风险，同时，在市场情绪低迷时寻找市场潜在投资机会。

（4）行业量化配置策略

从大的方面来分类，可以将行业分为周期性行业与非周期性行业，传统产业与战略新兴产业。从更细化的角度来看，可以将行业分为20-30个子行业。通过对关键量化指标的分析，比如行业景气指数、行业盈利指标、行业估值指标、行业动量指标、行业配置度指标等，通过量化模型综合判断进行行业的优化配置。

3、债券投资策略

本基金通过分析市场利率趋势、信用环境变化等因素，综合运用久期管理、收益率曲线策略、个券选择策略等策略，通过对不同券种收益率水平、信用分险、流动性等因素进行比较进行债券投资。以实现获取债券市场的长期稳定收益的目的。

4、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素，结合相关数量化定价模型，谨慎投资资产支持证券。

5、股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型和基差水平进行股指期货投资，以期进行风险管理和流动性管理，提高组合收益的稳定性。

6、权证投资策略

本基金在严格控制风险的前提下谨慎进行权证投资。权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资，基金参与权证投资以套期保值为目的。

八、基金的业绩比较基准

中证800指数收益率*65%+中证综合债券指数收益率*35%。

中证800指数由中证指数有限公司编制，该指数综合反映了沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，该指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，不易被操纵，并且有较高的知名度和市场影响力，适合作为本基金股票资产的业绩比较基准。中证综合债券指数由中证指数有限公司编制，该指数全面反映了我国债券市场的整体价格变动趋势，适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。

如果今后证券市场中有其他代表性更强，或者指数编制单位停止编制该指数，或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况在按照监管部门要求履行适当程序并经基金托管人同意后对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前