

# 东方臻宝纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2019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。本基金基金合同于2018年8月8日生效。

东方基金管理有限责任公司（以下简称“本基金管理人”）保证《东方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、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保证。

投资有风险，投资人在认购（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，因反收违约或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定风险，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，由投资人自行承担。

有关财务数据和净值表现截止日为2018年12月31日（财务数据未经审计），本招募说明书其他内容截止日为2019年2月8日。

## 一、基金合同生效日期

2018年8月8日

## 二、基金管理人

（一）基金管理人概况

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; 基金管理; 资产管理; 从事境外证券投资管理业务; 中国证监会许可的其他业务  
批准设立机关及批准设立文号: 中国证监会证监基金字[2004]80号  
统一社会信用代码: 911100007635106822  
联系人: 李景岩  
电话: 010-66296888  
股权结构:

股东名称	出资金额(人民币)	出资比例
东方证券股份有限公司	19,200.00元	64%
湖北国有资产管理集团有限公司	8,200.00元	27%
海南国际信托投资有限公司	3,000.00元	9%
合计	30,400.00元	100%

内部组织结构:

股东大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、公司组织管理发行委员会等下设的总经理负责制, 下设投资决策委员会、产品委员会、IT治理委员会、风险控制委员会和权益投资部、权益研究部、固定收益投资部、固定收益管理部、量化投资部、专户投资部、市场部、产品开发部、机构业务一部、战略客户部、电子商务部、运营部、交易部、信息技术部、财务部、人力资源部、综合管理部、董事会办公室、风险管理部、监察稽核部、财富管理部二十一个职能部门及北京分公司、上海分公司、广州分公司、成都分公司; 公司设督察长、分管风险管理部、监察稽核部, 负责组织指导公司的监察稽核工作。

## （二）基金管理人主要人员情况

1. 董事长、董事, 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, 副处长, 中国证监委组织处, 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基地办公室主任; 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, 吉林大學商学院教师, 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、东证融汇证券资产管理有限公司董事。

2. 张志先生, 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, 吉林亚盛(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, 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。现已退休。

3. 何俊岩先生, 董事, 硕士, 高级会计师、中国注册会计师、中国注册会计师评估师, 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, 客户资产管理部总经理, 福建闽纺纺织科技股份有限公司财务总监, 东北证券股份有限公司财务总监, 东北证券股份有限公司副总裁、常务副总裁, 东证融达投资管理有限公司董事, 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, 吉林省总工会会计协会副会长, 东证融达投资管理有限公司董事长, 东证融汇证券资产管理有限公司董事长。

4. 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, 河北联华商贸分店副经理, 省贸易厅审计处, 省商贸集团财务处(正科), 省工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、财务总监部部长、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。

5. 董丁先生, 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, 海航集团财务部经理, 金融客户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。

6. 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学专业教师, 贵州省财经学院会计学教授, 海南会计师事务所注册会计师, 证监会发行部发行审核员, 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。

7. 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, 吉林大學商学院教授、博士生导师; 现任吉林大學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。

8. 刘鸿鹏先生, 董事, 吉林大學管理专业硕士。曾任吉林物贸股份有限公司投资顾问, 君安证券有限责任公司长春办事处融资融券专员, 吉林省信托业公会筹建负责人, 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、营销管理部副经理, 经理, 2011年6月加盟本公司, 历任总经理助理兼财务总监、市场部经理, 公司副总经理, 现任公司总经理。

9. 监事会成员

赵振兵先生, 监事会主席, 本科, 高级经济师。历任河北华联商贸集团委办主任、总经理、副总, 河北省商贸集团任公司副

理, 河北省工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、华北铝业业有限公司副董事长。

10. 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。

11. 肖向辉先生, 监事, 本科。曾任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助理。

12. 其他高级管理人员

13. 崔伟先生, 董事长, 简历请参见董事介绍。

14. 刘鸿鹏先生, 总经理, 简历请参见董事介绍。

15. 秦群祥先生, 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、学校财务处副主任等职务; 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。

16. 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、北京管理部总经理。2004年6月加盟本公司, 曾任财务主管、财务经理, 财务负责人, 综合管理部经理兼人力资源部副经理、总经理助理。

## 4. 本基金基金经理

姓名	任职时间	简历
刘鸿鹏先生	2018年8月8日至至今	公司总经理助理, 固定收益研究总监, 固定收益研究部总经理, 投资决策委员会成员, 清华大学硕士, 12年投资从业经历, 曾任中国光大银行交易员, 中国工商银行金融市场部投资经理兼副经理、高级经理。2017年11月加盟东方基金管理有限责任公司, 现任东方双债稳健债券型证券投资基金、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理。东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理, 东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理。清华大学应用经济学专业硕士, 7年证券从业经历。2012年7月加盟东方基金管理有限责任公司, 曾任研究员研究员, 固定收益研究员, 投资经理, 东方双债稳健债券型证券投资基金基金经理, 东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理。东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理。
郭成军先生(先生)	2018年8月8日至至今	曾任研究员研究员, 固定收益研究员, 投资经理, 东方双债稳健债券型证券投资基金基金经理, 东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理。
郭成军先生(女士)	2018年8月8日至至今	曾任研究员研究员, 固定收益研究员, 投资经理, 东方双债稳健债券型证券投资基金基金经理, 东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理。

## 5. 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。

1. 许文波先生, 公司总经理助理, 权益投资总监, 量化投资部总经理, 投资决策委员会委员, 吉林大学工商管理硕士, 18年投资从业经历。曾任新华证券有限责任公司投资顾问部分析师; 东北证券股份有限公司资产管理部投资管理部投资经理、部门经理; 渤海基金管理有限公司基金管理部投资研究部总经理。2018年4月加盟东方基金管理有限责任公司, 现任东方精选混合型开放式证券投资基金、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理。

2. 彭成军先生, 简历请参见基金经理介绍。

3. 蒋吾先生, 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, 9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、瀚海人寿保险股份有限公司投资总监, 2017年6月加盟东方基金管理有限责任公司, 曾任研究部总经理。现任东方支柱产业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、东方主题精选混合型证券投资基金基金经理。

4. 王然女士, 权益研究部副总经理, 投资决策委员会委员, 北京交通大学产业经济学硕士, 11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、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, 东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理, 东方民丰回报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, 东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 东方合家保本混合型证券投资基金基金经理, 东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 现任东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理, 东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理, 东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 东方民丰回报混合型证券投资基金基金经理, 东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 东方大健康混合型证券投资基金基金经理。

5. 姚女士, 固定收益投资部副总经理, 投资决策委员会委员, 中国人民大学工商管理硕士, 15年证券从业经历。曾就职于嘉实基金管理有限公司运营部。2010年10月加盟东方基金管理有限责任公司, 曾任债券交易员, 东方金帐簿货币市场证券投资基金基金经理助理, 东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 东方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日起转型为东方成长收益平衡混合型证券投资基金)基金经理, 东方民丰回报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, 东方民丰回报混合型证券投资基金基金经理, 东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 东方大健康混合型证券投资基金基金经理。

6. 上述人员之间不存在近亲属关系。

## 三、基金托管人

（一）基金托管人概况  
名称: 中国光大银行股份有限公司  
住所及办公地址: 北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

成立日期: 1992年6月18日  
批准设立机关和批准设立文号: 国务院、国函[1992]7号  
组织形式: 股份有限公司  
注册资本: 466.79096亿元人民币  
法定代表人: 李晓鹏  
基金托管业务批准文号: 中国证监会证监基字[2002]75号

投资与托管业务部总经理: 张博  
电话: (010) 66363663  
传真: (010) 63639132  
网址: www.cebbank.com

（二）投资与托管业务部门及主要人员情况  
法定代表人李敬鹏先生, 曾任中国工商银行河南省分行党组成员、副行长, 中国工商银行总行营业部总经理, 中国工商银行四川省分行党委书记、行长, 中国华融资产管理公司党委委员、副总裁, 中国工商银行党委委员、行长助理兼北京市分行行长, 中国工商银行党委委员、副行长, 中国工商银行股份有限公司党委委员、副行长、执行董事; 中国投资有限责任公司党委副书记、监事长; 招商局集团副董事长、总经理、党委副书记。曾兼任工银国际控股有限公司董事长、工银金融资产投资有限公司董事长、工银瑞信基金管理公司董事长、招商银行股份有限公司副董事长、招商局能源运输股份有限公司董事长、招商局港口控股有限公司董事长、招商局华建公路投资发展有限公司董事长、招商局资本发展有限公司董事长等职务。现任中国光大集团股份公司党委书记、董事长, 兼任中国光大银行股份有限公司党委书记、董事长, 中国光大集团有限公司董事长, 中国旅游协会副会长、中国城市金融学会副会长、中国农村金融学会副会长。武汉大学金融学博士研究生、经济学博士, 高级经济师。

行长葛海蛟先生, 曾任中国农业银行辽宁省分行国际业务部总经理

助理、副总经理, 总经理, 中国农业银行辽宁省辽阳市分行党委书记、行长, 中国农业银行大连市分行党委书记, 副行长, 中国农业银行新加坡分行总经理, 中国农业银行国际业务部副总经理(部门总经理级), 中国农业银行黑龙江省分行党委副书记、党委书记、行长兼任悉尼分行海外高管

公司董事长, 光大证券股份有限公司董事, 中国光大集团股份公司上海总部主任, 中国光大集团股份公司文旅健康事业部总经理。现任中国光大银行股份有限公司党委副书记、行长, 中国光大集团股份公司党委委员。

南京农业大学农业经济管理专业博士研究生, 管理学博士, 高级经济师。

张博先生, 曾任中国光大银行厦门分行副行长, 西安分行行长, 乌鲁木齐分行筹备组组长、分行行长, 青岛分行行长, 光大消费金融公司筹备组组长, 曾兼任中国光大银行电子银行部副总经理(总经理级), 负责普惠信贷团队业务。现任中国光大银行投资与托管业务部总经理。

（三）证券投资业务托管情况

截至2018年12月31日, 中国光大银行股份有限公司托管华夏睿誉泰利六个月定期开放混合型证券投资基金, 天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金等共128只证券投资基金, 托管基金资产规模3091.02亿元。同时, 开展了保险公司债券管理计划、专户理财、企业年金基金、ODDI、银行理财、结构化股权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

（四）托管业务的内部控制制度

1. 内部控制目标  
确保有关法律法规在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行; 确保基金托管人有关基金托管的各项管理制度和业务操作规程在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行; 确保基金财产安全; 保证基金托管业务稳健运行; 保护基金份额持有人、基金管理公司及基金托管人的合法权益。

2. 内部控制的原则  
(1) 全面性原则: 内部控制必须渗透到基金托管业务的各个操作环节, 覆盖所有的岗位, 不留任何死角。

(2) 预防性原则: 树立“预防为主”的管理理念, 从风险发生的源头加强内部控制, 防患于未然, 尽量避免业务操作中各种问题的产生。

(3) 及时性原则: 建立健全各项规章制, 采取有效措施加强内部控制。发现问题, 及时纠正, 堵塞漏洞。

(4) 独立性原则: 基金托管业务内部控制机构独立于基金托管业务执行机构, 业务操作人员和内控人员分开, 以保证内控机构的工作不受干扰。

3. 内部控制组织结构  
中国光大银行股份有限公司董事会下设风险管理委员会、审计委员会, 委员会由相关部门的负责人担任, 工作重点是对总行各部门、各类业务的风险和内控进行监督、管理和协调, 建立横向的内控管理控制体制。各部门负责分管系统内的内部控制的风险控制, 建立纵向的内控管理控制体制。投资与托管业务部建立了严格的内控督察体系, 设立了风险管理处, 负责证券投资基金托管业务的风险管理。

4. 内部控制制度  
中国光大银行股份有限公司投资与托管业务部自成立以来严格遵照《基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《信息披露办法》、《运作办法》、《销售办法》等法律法规的要求, 并根据相关法律法规制订、完善了《中国光大银行证券投资基金托管业务内部控制制度》、《中国光大银行投资与托管业务部保密规定》等十余项规章制度和实施细则, 将风险控制落实到每一个工作环节, 中国光大银行投资与托管业务部按照和防范基金托管业务风险为主线, 在重要岗位(基金清算、基金核算、监督稽核)还建立了安全保密区, 安装了录像监视系统和录音监听系统, 以确保基金的安全。

(五) 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序  
根据法律法规和基金合同等的要求, 基金托管人主要通过定性和定量相结合、事前监督和事后控制相结合、技术与人工监督相结合的方式, 对基金投资品种、投资组合比例每日进行监督; 同时, 对基金管理人就基金资产净值的计算、基金管理人和基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配、基金费用支付等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人存在违反法律法规和基金合同等规定的行为, 及时以书面或电话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作出书面回。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。基金托管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。

## 四、相关服务机构

（一）直销机构  
1. 柜台交易  
名称: 东方基金管理有限责任公司直销中心  
住所: 北京市西城区锦什坊街28号1-4层  
办公地址: 北京市西城区锦什坊街28号3层  
法定代表人: 崔伟  
联系人: 孙桂东  
电话: 010-66295921  
传真: 010-66578690  
网址: www.orient-fund.com或www.df5888.com

2. 电子交易  
投资者可以通过基金管理人网上交易系统办理基金申购、赎回等业务, 具体业务办理情况及业务规则请登录基金管理人网站查询。网址: www.orient-fund.com 或www.df5888.com

（二）其他销售机构  
1. 中国光大银行股份有限公司  
住所: 北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心  
办公地址: 北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心  
法定代表人: 李晓鹏  
联系人: 朱红  
电话: 010-63636153  
传真: 010-63639709  
客服电话: 96595

2. 东北证券股份有限公司  
住所: 长春市生态大街6666号  
办公地址: 长春市生态大街6666号  
法定代表人: 李福春  
联系人: 安启智  
电话: 0431-85096517  
传真: 0431-85096976  
客服电话: 96360  
网址: www.nescc.com

3. 光大证券股份有限公司  
住所: 上海市静安区新闸路1508号  
办公地址: 上海市静安区新闸路1508号3楼  
法定代表人: 周健男  
联系人: 戴巧燕  
电话: 021-22169999  
传真: 021-22169134  
客服电话: 96626

4. 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A座  
法定代表人: 陈有安  
联系人: 宋明  
电话: 010-66568450  
传真: 010-66568390  
客服电话: 400-888-8888  
网址: www.chinastock.com.cn

（三）份额登记机构  
名称: 东方基金管理有限责任公司  
住所: 北京市西城区锦什坊街28号1-4层  
办公地址: 北京市西城区锦什坊街28号1-4层  
法定代表人: 崔伟  
联系人: 李进康  
电话: 010-66295874  
传真: 010-66578690  
网址: www.orient-fund.com或www.df5888.com

（四）律师事务所和经办律师  
名称: 北京德恒律师事务所  
住所: 北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层  
负责人: 王丽  
联系人: 刘焕志  
电话: 010-52682888  
传真: 010-52682999  
经办律师: 刘焕志、孙艳利

（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(特殊普通合伙)  
住所: 上海市南京东路61号4楼  
办公地址: 北京市东城区东直门内大街16号瑞泰楼10层  
法定代表人: 朱建弟  
联系人: 朱彤梅  
电话: 010-66286868  
传真: 010-88212068  
经办注册会计师: 朱梅梅、高慧丽

## 五、基金名称和基金类型

（一）本基金名称: 东方臻宝纯债债券型证券投资基金

（二）本基金类型: 债券型证券投资基金

（三）基金运作方式: 契约型、开放式

## 六、基金的投资目标和投资方向

（一）投资目标  
在严格控制风险并保持良好流动性的基础上, 追求基金资产的长期稳健增值。

（二）投资范围  
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国债、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(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金不投资股票、权证等权益类资产, 也不投资可转换债券、可交换债券。

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

基金的投资组合比例为: 债券资产占基金资产的比例不低于80%, 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 本基金持有的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。

当法律法规的相关规定变更时, 基金管理人根据法律从法规的规定或在履行适当程序后对上述资产配置比例进行适当调整。

## 七、基金的投资策略

本基金根据宏观经济运行情况、货币政策走向、金融市场运行趋势和市场利率水平变化特点等进行分析研究, 优选具有投资价值品种, 在严格控制风险并保持良好流动性的基础上, 实现基金的持续稳定增值。

（一）类属资产配置策略  
鉴于各种种的收益变化率和利差变化的影响因素存在差异, 且各阶段内的各种种波动性特征也存在不同, 本基金通过综合分析, 比较各种种的利差变化趋势、收益率水平、市场偏好、流动性等特征, 结合具体宏观经济环境、政策环境的变化等因素, 合理配置并动态调整类属债券的投资比例。

根据债券的发行主体、风险来源、收益率水平、市场流动性等因素, 本基金将债券市场主要划分为一般债券(含国债、中央银行票据、政策性金融债等)和信用债券(含公司债、企业债、非政策性金融债、短期融资券、地方政府债等)两大类。

1. 一般债券投资策略  
国债、中央银行票据、政策性金融债等一般债券具有良好的流动性, 本基金将通过对一般债券的投资为基金的流动性提供支持。

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

（二）久期调整策略  
在全面分析宏观经济环境与政策趋向等因素的基础上, 本基金将通过调整债券资产组合的久期, 达到增加收益或减少损失的目的。当预期市场总体利率水平下降时, 本基金将延长持有期的债券组合的久期, 从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升所带来的资本利得; 反之, 当预期市场总体利率水平上升时, 则缩短组合久期, 以避免债券价格下降的风险带来的资本损失, 并获得较高的再投资收益。

（三）期限结构策略  
在债券资产久期确定的基础上, 本基金将通过对待债券市场收益率曲线形状变化的合理预期, 调整组合的期限结构策略, 适当的采取子弹策略、哑铃策略、梯式策略等, 在短期、中期、长期债券间进行配置, 以从短、中、长期债券的相对价格变化中获利收益。当预期收益率曲线变陡时, 采取子弹策略; 当预期收益率曲线变平时, 采取哑铃策略; 当预期收益率曲线不变或平行移动时, 采取梯式策略。

（四）资产支持证券投资策略  
本基金将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和流动性管理机会等积极策略, 在严格遵守法律法规和基金合同基础上, 通过信用研究和流动性管理, 选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资, 以期获得长期稳定收益。

（五）国债期货投资策略  
本基金在进行国债期货投资时, 将根据风险管理原则, 以套期保值为主要目的, 通过流动性好、交易活跃的期货合约, 通过对国债市场和期货市场运行趋势的研究, 结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平, 通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征, 利用金融衍生品的杠杆作用, 以达到降低投资组合的整体风险的目的。

（六）其他金融工具的投资策略  
如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他衍生金融工具, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。本基金将在有效风险管理的前提下, 通过对标的品种的基本面研究, 结合衍生工具定价模型预估衍生工具价值或风险对冲比例, 谨慎投资。

## 八、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为: 中债综合全价指数收益率

本基金选择上述业绩比较基准的原因为本基金主要通过投资于债券等固定收益类资产获取收益, 力争获取相对稳健的投资, 追求基金资产的长期稳定增值。中债综合全价指数由中央国债登记结算有限公司编制, 该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况, 具有广泛的市场代表性, 符合本基金的投资目标。

若未来法律法规发生变化, 或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出, 或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布, 本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则, 在与基金托管人协商一致, 履行适当程序后, 适当调整业绩比较基准并及时公告, 无需召开基金份额持有人大会。

## 九、基金的风险收益特征

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

## 十、投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本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, 已复核了本报告组合报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容, 保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告组合报告所载数据截至2018年12月31日(财务数据未经审计)

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
其中: 股票	-	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,756,938,960.00	96.12
其中: 债券	1,704,402,980.00	96.24	
资产支持证券	51,536,000.00	2.88	
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-	