东方臻宝纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2020年第4号）

基金管理人：东方基金管理股份有限公司
基金托管人：中国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。

东方基金管理股份有限公司（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、基金产品资料概要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。

根据中国证监会2019年9月1日起施行的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的要求，经与相关基金托管人协商一致，本基金管理人对旗下部分基金的基金合同及托管协议进行了修订，报监管部门备案并按规定在指定媒介上公告。

公司名称及基金管理人相关内容截止日为2020年8月24日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年6月30日（财务数据未经审计），本招募说明书其他所在内容截止日为2019年8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：东方基金管理股份有限公司
住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层
办公地址：北京市西城区锦什坊街28号1-4层
邮政编码：100033
法定代表人：崔伟
成立时间：2004年6月11日
组织形式：股份有限公司
注册资本：叁亿叁仟叁佰叁拾叁万元人民币
营业期限：2004年6月11日至长期
经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；从事境外证券投资管理业务；中国证监会许可的其他业务
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]80号
统一社会信用代码：911100007635106822
联系人：李景岩
电话：010-66295888
股权结构：

股东名称	认购股份数（万股）	持股比例
东北证券股份有限公司	19200	57.60%
河北国控资本管理有限公司	8100	24.30%
渤海国际信托股份有限公司	2700	8.10%
天津汇智长行企业管理咨询中心（有限合伙）	1170	3.51%
天津汇远长行企业管理咨询中心（有限合伙）	1123	3.37%
天津汇聚长行企业管理咨询中心（有限合伙）	1040	3.12%
合 计	33333	100%

内部组织结构：

股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会，董事会下设合规与风险控制委员会、薪酬与考核委员会；公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制，下设投资决策委员会、产品委员会、IT治理委员会、风险控制委员会、估值委员会、反洗钱工作组和权益投资部、权益研究部、固定收益投资部、固定收益研究部、量化投资部、专户投资部、市场部、产品开发部、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.董事会成员

崔伟先生，董事长，经济学博士。历任中国人民银行副主任科员、主任科员、副处级秘书，中国证监会党组秘书、秘书处副处长、处长，中国人民银行东莞中心支行副行长、党委委员，中国人民银行汕头中心支行行长、党委书记兼国家外汇管理局汕头中心支局局长，中国证监会海南监管局副局长兼党委委员、局长兼党委书记，中国证监会协调部副主任兼中国证监会投资者教育办公室召集人，中国证券投资基金业协会第一届理事；现任东方基金管理股份有限公司董事长，兼任东北证券股份有限公司副董事长、中国证券投资基金业协会第二届监事、东方汇智资产管理有限公司董事长、东证融汇证券资产管理有限公司董事。何俊岩先生，董事，硕士，高级会计师、中国注册会计师、中国注册资产评估师，吉林省五一劳动奖章获得者。历任吉林省五金矿产进出口公司计划财务部财务科长，东北证券有限责任公司计划财务部总经理、客户资产管理总部总经理，福建凤竹纺织科技股份有限公司财务总监，东北证券有限责任公司财务总监，东北证券股份有限公司副总裁、常务副总裁，东证融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长，东证融汇证券资产管理有限公司董事。

李雪飞先生，董事，硕士。曾任吉林建设开发集团公司党委文书，吉林省国际信托投资公司职员，华泰证券股份有限公司长春同志街营业部交易部经理、总经理助理，东北证券股份有限公司长春自由大路证券营业部总经理、长春同志街第三证券营业部总经理、营销管理部总经理、客户服务部总经理、机构业务部总经理、总裁助理、经纪业务发展与管理委员会主任、金融产品部总经理、职工监事、东证融达投资有限公司董事；现任东北证券股份有限公司党委委员、副总裁、经纪业务发展与管理委员会主任，兼任东证融汇证券资产管理有限公司副董事长、渤海期货股份有限公司董事。

王真女士，董事，工商管理硕士。曾任沧州日报社记者，燕赵都市报社经济新闻部主任，河北青年报社副总编辑，河北建设投资集团有限公司集团办公室副主任，河北省国有资产控股运营有限公司战略投资部部长；现任河北省国有资产控股运营有限公司总裁助理、资本运营总监，兼任河北国控资本管理有限公司党委书记、董事长。

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

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

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

刘峰先生，独立董事，大学本科。历任湖北省黄石市律师事务所副主任，海南方圆律师事务所主任；现任上海市锦天城律师事务所高级合伙人，兼任梓昆科技（中国）股份有限公司独立董事，三角轮胎股份有限公司独立董事，长华化学科技股份有限公司独立董事，中华全国律师协会律师发展战略研究委员会副主任，金融证券委员会委员，并被国家食品药品监督管理总局聘为首批餐饮服务食品安全法律组专家。

刘鸿鹏先生，董事，吉林大学行政管理硕士。曾任吉林物贸股份有限公司投资顾问，君安证券有限责任公司长春办事处融资融券专员，吉林省信托营业部筹建负责人，新华证券股份有限公司长春同志街营业部副经理、经理，东北证券股份有限公司杭州营业部经理、营销管理总部副经理、经理。2011年5月加盟本公司，历任总经理助理兼市场总监、市场部经理，公司副总经理；现任公司总经理兼首席信息官。

2.监事会成员

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

周鑫先生，监事，硕士研究生。曾任职北京时代博讯高科技有限公司、太平洋证券有限责任公司、北京航天辰光精密仪器有限公司等机构；现任东方基金管理股份有限公司综合管理部总经理兼人力资源部总经理。

王丹丹女士，监事，硕士研究生。曾任职工银瑞信基金管理有限公司、英大基金管理有限公司；现任东方基金管理股份有限公司产品开发部总经理兼运营部总经理、交易部总经理。

3.其他高级管理人员

崔伟先生，董事长，简历请参见董事介绍。

刘鸿鹏先生，总经理兼首席信息官，简历请参见董事介绍。

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

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

杨贵宾先生，副总经理兼固定收益投资总监，投资决策委员会委员，东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。西安交通大学经济学博士。历任富国基金管理有限责任公司固定收益研究员、基金经理，上海海通证券资产管理有限公司工作，任投资主办、固定收益投资总监、公司总经理助理；2019年9月加盟本公司，曾任总经理助理兼固定收益投资总监。

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

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

4.本基金基金经理

姓名	任职时间	简历
郑雪莹（女士）	2020年5月11日至今	复旦大学财务学专业硕士，5年证券从业经历。2015年加盟本公司，曾任固定收益研究部研究员、交易部债券交易员，东方永熙18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、东方金元宝货币市场基金基金经理助理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理助理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理助理、东方新价值混合型证券投资基金基金经理助理、东方惠新灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金证通货币市场基金基金经理助理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、东方永熙18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，现任东方金元宝货币市场基金基金经理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方金证通货币市场基金基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金经理。
周薇（女士）	自2019年4月30日至2020年5月13日担任本基金基金经理。	
彭成军（先生）	自2018年8月8日至2019年4月29日担任本基金基金经理。	
黄诺楠（女士）	自2018年9月20日至2019年3月8日担任本基金基金经理。	

5.投资决策委员会成员

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

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

许文波先生，公司总经理助理、权益投资总监、投资决策委员会委员。吉林大学工商管理硕士，19年投资从业经历。曾任新华证券有限责任公司投资顾问部分析师；东北证券股份有限公司资产管理分公司投资管理部投资经理、部门经理；德邦基金管理有限公司基金经理、投资研究部总经理。2018年4月加盟本公司，曾任东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理、东方欣利混合型证券投资基金基金经理。

蒋茜先生，权益投资部总经理，投资决策委员会委员。清华大学工商管理硕士，10年证券从业经历。曾任GCW Consulting高级分析师、中信证券高级经理、天安财产保险股份有限公司研究总监、渤海人寿保险股份有限公司投资总监。2017年5月加盟本公司，曾任研究部总经理，东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理，现任东方主题精选混合型证券投资基金基金经理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理、东方创新科技混合型证券投资基金基金经理、东方人工智能主题混合型证券投资基金基金经理。

王然女士，权益研究部副总经理，投资决策委员会委员。北京交通大学产业经济学硕士，12年证券从业经历。曾任益民基金交通运输、纺织服装、轻工制造行业研究员。2010年4月加盟本公司，曾任权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究员，东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于2015年8月7日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理助理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于2015年8月7日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金（于2017年5月11日转型为东方成长收益平衡混合型证券投资基金）基金经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金（于2017年9月13日起转型为东方民丰回报赢安混合型证券投资基金）基金经理、东方成长收益平衡混合型证券投资基金（于2018年1月17日转型为东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金）基金经理、东方大健康混合型证券投资基金基金经理、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理，现任东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方城镇消费主题混合型证券投资基金基金经理。

吴萍萍女士，固定收益投资部副总经理，投资决策委员会委员。中国人民大学应用经济学硕士，9年证券从业经历。曾任安信证券投资组资金交易员、民生加银基金管理有限公司专户投资经理。2015年11月加盟本公司，曾任东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理助理、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理助理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金（于2019年8月2日起转型为东方成长回报平衡混合型证券投资基金）基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理、东方臻悦纯债债券型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理，现任东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理、东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理、东方卓行18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方永悦18个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻萃 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。

6.上述人员之间不存在近亲属关系。

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：466.79095亿元人民币
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）63636363
传真：（010）63639132
网址：www.cebbank.com

（二）投资与托管业务部部门及主要人员情况

法定代表人李晓鹏先生，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、工银金融租赁有限公司董事长、工银瑞信基金管理有限公司董事长、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会主席、招商局华建公路投资有限公司董事长、招商局资本投资有限责任公司董事长、招商局联合发展有限公司董事长、招商局投资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委员、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，黑龙江省第十二届人大代表。曾兼任中国光大实业（集团）有限责任公司董事长，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，中国光大集团有限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），负责普惠贷款团队业务。现任中国光大银行投资与托管业务部总经理。

（三）证券投资基金托管情况

截至2019年6月30日，中国光大银行股份有限公司托管华夏睿磐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149只证券投资基金，托管基金资产规模3248.54亿元。同时，开展了证券公司资产管理计划、专户理财、企业年金基金、QDII、银行理财、保险债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度，采取有效措施加强内部控制。发现问题，及时处理，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，委员会委员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制约体制。各部门负责分管系统内的内部控制的组织实施，建立纵向的内控管理制约体制。投资与托管业务部建立了严密的内控督察体系，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规定》、《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以控制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，以保障基金信息的安全。

（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等方式方法，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的违反法律、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发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

四、相关服务机构

（一）直销机构

1.柜台交易

名称：东方基金管理股份有限公司直销中心
住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层
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：史鹏浩
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等办理基金的申购、赎回等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录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：李晓鹏
联系人：朱红
电话：010-63636153
传真：010-63639709
客服电话：95595
网址：www.cebbank.com

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：安岩岩
电话：0431-85096517
传真：0431-85096795
客服电话：95360
网址：www.nesc.cn

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：95525
网址：www.ebscn.com

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C座
法定代表人：陈有安
联系人：宋明
电话：010-66568450
传真：010-66568990
客服电话：400-888-8888
网址：www.chinastock.com.cn

5、中信证券（山东）有限责任公司
住所：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层
法定代表人：姜晓林
联系人：刘晓明
电话：0531－89606165
传真：0532－85022605
客服电话：95548
网址：www.zxwt.com.cn

6、中信证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人：张佑君
联系人：郑慧
电话：010-6083 8888
传真：010-6083 6029
客服电话：95548
网址：www.cs.ecitic.com

7、中信期货有限公司
住所：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人：张皓
联系人：刘宏莹
电话：010-60833754
传真：0755-83201097
客服电话：400-990-8826
网址：www.citicsf.com

8、阳光人寿保险股份有限公司
住所：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层
办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层
法定代表人：李科
客户服务电话：95510
网址：fund.sinosig.com

9、南京苏宁基金销售有限公司
住所：南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址：南京市玄武区徐庄软件园苏宁大道1号
法定代表人：王锋
联系人：张云飞
电话：13016933367
客服电话：025-66996699
网址：www.snjijin.com

10、西藏东方财富证券股份有限公司
住所：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼
办公地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼
法定代表人：陈宏
联系人：付佳
电话：17717379005
客服电话：95357
网址：www.18.cn

11、江苏汇林保大基金销售有限公司
住所：南京市高淳区经济开发区古檀大道47号
办公地址：南京市鼓楼区中山北路105号中环国际1413室
法定代表人：吴言林
联系人：孙平
电话：13564999938
客服电话：025-66046166
网址：www.huilinbd.com

（三）份额登记机构

名称：东方基金管理股份有限公司
住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层
办公地址：北京市西城区锦什坊街28号1-4层
法定代表人：崔伟
联系人：张力苍
电话：010－66295874
传真：010－66578680
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：北京市海淀区西四环中路16号院7号楼10层
法定代表人：朱建弟
联系人：朱锦梅
电话：010-68286868
传真：010-88210608
经办注册会计师：朱锦梅、高慧丽

五、基金名称和基金类型

（一）本基金名称：东方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的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，优选具有投资价值的个券，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

鉴于各券种的收益率变化和利差变化的影响因素存在差异，且各经济阶段内的各券种波动性特征也存在不同，本基金通过综合分析、比较各券种的利差变化趋势、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、信用债券投资策略

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

（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降低时，本基金将延长所持有的债券组合的久期，从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升所产生的资本利得；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取收益。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，采取梯形策略。

（四）资产支持证券投资策略

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

（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，采用流动性好、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：中债总全价指数收益率

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得收益，力争获取相对稳健的回报，追求基金资产的长期稳定增值。中债总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，或者有更权威的、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投资组合报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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

本投资组合报告所载数据截至2019年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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,609,704,681.00	76.05
	其中：债券	1,609,704,681.00	76.05
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	75,600,377.40	3.57
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	394,057,517.20	18.62
8	其他资产	37,336,358.50	1.76
9	合计	2,116,698,934.10	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	255,011,153.00	12.71
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,354,693,528.00	67.54
	其中：政策性金融债	1,354,693,528.00	67.54
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,609,704,681.00	80.25

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	180209	18国开09	8,000,000	800,240,000.00	39.90
2	090208	09国开08	2,000,000	199,960,000.00	9.97
3	020296	19贴债19	1,500,000	148,260,000.00	7.39
4	160313	16进出13	1,000,000	100,110,000.00	4.99
5	108603	国开1804	935,500	93,606,130.00	4.67

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

10、投资组合报告附注

（1）本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

（2）本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

（3）其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	58,133.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	37,278,224.03
5	应收申购款	1.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,336,358.50

（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

本基金本报告期末未持有股票。

十一、基金的业绩

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

（一） 基金净值表现

本期报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

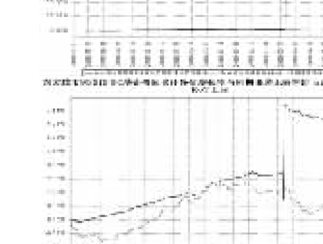
东方臻宝纯债债券A

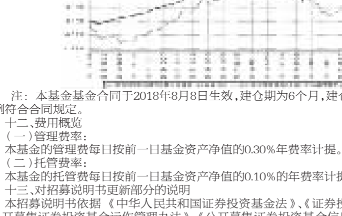
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
2018.08.08-2018.12.31	1.69%	0.03%	1.91%	0.11%	-0.22%	-0.08%
2019.01.01-2019.03.31	259.39%	30.57%	0.15%	0.09%	259.24%	30.48%
2019.04.01-2019.06.30	2.56%	0.39%	-0.53%	0.11%	3.09%	0.28%

东方臻宝纯债债券C

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
2018.08.08-2018.12.31	1.84%	0.03%	1.91%	0.11%	-0.07%	-0.08%
2019.01.01-2019.03.31	5.45%	0.81%	0.15%	0.09%	5.30%	0.72%
2019.04.01-2019.06.30	-0.74%	0.05%	-0.53%	0.11%	-0.21%	-0.06%

（二）自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注：本基金基金合同于2018年8月8日生效，建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

十二、费用概览

（一）管理费率：

本基金的管理费每日按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。

（二）托管费率：

本基金的托管费每日按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。

十三、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关规定以及《东方臻宝纯债债券型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动进行了更新，主要内容如下：

（一）本公司改制为股份有限公司，名称变更为"东方基金管理股份有限公司"。

（二）在"第三部分 基金管理人"部分，更新了基金管理人的相关内容。

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

东方基金管理股份有限公司
2020年8月

东方臻慧纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2020年第1号）

基金管理人：东方基金管理股份有限公司
基金托管人：上海银行股份有限公司

重要提示

东方臻慧纯债债券型证券投资基金（以下简称"本基金"）根据2020年3月23日中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）《关于准予东方臻慧纯债债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2020]537号）准予募集注册。

东方基金管理股份有限公司（以下简称"本基金管理人"）保证《东方臻慧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、基金产品资料概要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。

本基金在投资中将国债期货纳入投资范围中，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。

本基金将资产支持证券纳入到投资范围当中，可能带来以下风险：

①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。

②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。

③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。

④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。

⑤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。

⑥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。

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。

本基金基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于2020年9月1日起执行。

公司名称及基金管理人相关内容截止日为2020年8月24日。

一、基金合同生效日期

2020年5月21日

二、基金管理人

（一）基金管理人基本情况

名称：东方基金管理股份有限公司
住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层
办公地址：北京市西城区锦什坊街28号1-4层
邮政编码：100033
法定代表人：崔伟
成立时间：2004年6月11日
组织形式：股份有限公司
注册资本：叁亿叁仟叁佰叁拾叁万元人民币
存续期间：2004年6月11日至长期
经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；从事境外证券投资管理业务；中国证监会许可的其他业务
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]80号
统一社会信用代码：911100007635106822
联系人：李景岩
电话：010-66295888
股权结构：

股东名称	认购股份数（万股）	持股比例
东北证券股份有限公司	19200	57.60%
河北国控资本管理有限公司	8100	24.30%
渤海国际信托股份有限公司	2700	8.10%
天津汇智长行企业管理咨询中心（有限合伙）	1170	3.51%
天津汇远长行企业管理咨询中心（有限合伙）	1123	3.37%
天津汇聚长行企业管理咨询中心（有限合伙）	1040	3.12%
合 计	33333	100%

内部组织结构：

股东会是公司的最高权力机构，下设董事会和监事会，董事会下设合规与风险控制委员会、薪酬与考核委员会；公司组织管理实行董事会领导下的总经理负责制，下设投资决策委员会、产品委员会、IT治理委员会、风险控制委员会、估值委员会、反洗钱工作组和权益投资部、权益研究部、固定收益投资部、固定收益研究部、量化投资部、专户投资部、产品开发部、机构业务一部、战略客户部、市场部、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风险管理和监察稽核工作。（二）基金管理人主要人员情况

1.董事会成员

崔伟先生，董事长，经济学博士。历任中国人民银行副主任科员、主任科员、副处级秘书，中国证监会党组秘书、秘书处副处长、处长，中国人民银行东莞中心支行副行长、党委委员，中国人民银行汕头中心支行行长、党委书记兼国家外汇管理局汕头中心支局局长，中国证监会海南监管局副局长兼党委委员、局长兼党委书记，中国证监会协调部副主任兼中国证监会投资者教育办公室召集人，中国证券投资基金业协会第一届理事；现任东方基金管理股份有限公司董事长，兼任东北证券股份有限公司副董事长，中国证券投资基金业协会第二届监事，东方汇智资产管理有限公司董事长、东证融汇证券资产管理有限公司董事。

何俊岩先生，董事，硕士，高级会计师、中国注册会计师、中国注册资产评估师，吉林省五一劳动奖章获得者。历任吉林省五金矿产进出口公司计划财务部财务科长，东北证券有限责任公司计划财务部总经理、客户资产管理总部总经理，福建凤竹纺织科技股份有限公司财务总监，东北证券有限责任公司财务总监，东北证券股份有限公司副总裁、常务副总裁，东证融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长、东证融汇证券资产管理有限公司董事。

李雪飞先生，董事，硕士。曾任吉林建设开发集团公司党委文书，吉林省国际信托投资公司职员，华泰证券股份有限公司长春同志街营业部交易部经理、总经理助理，东北证券股份有限公司长春自由大路证券营业部总经理、长春同志街第三证券营业部总经理、营销管理部总经理、客户服务部总经理、机构业务部总经理、总裁助理、经纪业务发展与管理委员会主任、金融产品部总经理、职工监事、东证融达投资有限公司董事；现任东北证券股份有限公司党委委员、副总裁、经纪业务发展与管理委员会主任，兼任东证融汇证券资产管理有限公司副董事长、渤海期货股份有限公司董事。

王真女士，董事，工商管理硕士。曾任沧州日报社记者，燕赵都市报社经济新闻部主任，河北青年报社副总编辑，河北建设投资集团有限公司集团办公室副主任，河北省国有资产控股运营有限公司战略投资部部长；现任河北省国有资产控股运营有限公司总裁助理、资本运营总监，兼任河北国控资本管理有限公司党委书记、董事长。

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

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

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

刘峰先生，独立董事，大学本科。历任湖北省黄石市律师事务所副主任，海南方圆律师事务所主任；现任上海市锦天城律师事务所高级合伙人，兼任梓昆科技（中国）股份有限公司独立董事，三角轮胎股份有限公司独立董事，长华化学科技股份有限公司独立董事，中华全国律师协会律师发展战略研究委员会副主任，金融证券委员会委员，并被国家食品药品监督管理总局聘为首批餐饮服务食品安全法律组专家。

刘鸿鹏先生，董事，吉林大学行政管理硕士。曾任吉林物贸股份有限公司投资顾问，君安证券有限责任公司长春办事处融资融券专员，吉林省信托营业部筹建负责人，新华证券股份有限公司长春同志街营业部副经理、经理，东北证券股份有限公司杭州营业部经理、营销管理总部副经理、经理。2011年5月加盟本公司，历任总经理助理兼市场总监、市场部经理，公司副总经理；现任公司总经理兼首席信息官。

2.监事会成员

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

周鑫先生，监事，硕士研究生。曾任职北京时代博讯高科技有限公司、太平洋证券有限责任公司、北京航天辰光精密仪器有限公司等机构；现任东方基金管理股份有限公司综合管理部总经理兼人力资源部总经理。

王丹丹女士，监事，硕士研究生。曾任职工银瑞信基金管理有限公司、英大基金管理有限公司；现任东方基金管理股份有限公司产品开发部总经理兼运营部总经理、交易部总经理。

3.高级管理人员

崔伟先生，董事长，简历请参见董事介绍。

刘鸿鹏先生，总经理兼首席信息官，简历请参见董事介绍。

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

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

杨贵宾先生，副总经理兼固定收益投资总监，投资决策委员会委员，东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。西安交通大学经济学博士。历任富国基金管理有限责任公司固定收益研究员、基金经理，上海海通证券资产管理有限公司工作，任投资主办、固定收益投资总监、公司总经理助理；2019年9月加盟本公司，曾任总经理助理兼固定收益投资总监。

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

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

4.本基金基金经理

姓名	任职时间	简历
刘长俊（先生）	2020年5月21日至今	固定收益研究部副总经理，上海财经大学金融学硕士，9年投资从业经历。曾任平安银行股份有限公司投资经理、德邦基金管理有限责任公司固定收益研究员、基金经理。2019年7月加盟本公司，现任东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方卓行18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方臻慧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，总经理兼首席信息官，投资决策委员会主任委员，简历请参见董事介绍。

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

许文波先生，公司总经理助理、权益投资总监、投资决策委员会委员。吉林大学工商管理硕士，19年投资从业经历。曾任新华证券有限责任公司投资顾问部分析师；东北证券股份有限公司资产管理分公司投资管理部投资经理、部门经理；德邦基金管理有限公司基金经理、投资研究部总经理。2018年4月加盟本公司，曾任东方双债添利债券型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理、东方欣利混合型证券投资基金基金经理。

蒋茜先生，权益投资部总经理，投资决策委员会委员。清华大学工商管理硕士，10年证券从业经历。曾任GCW Consulting高级分析师、中信证券高级经理、天安财产保险股份有限公司研究总监、渤海人寿保险股份有限公司投资总监。2017年5月加盟本公司，曾任研究部总经理，东方支柱产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理，现任东方主题精选混合型证券投资基金基金经理、东方人工智能主题混合型证券投资基金基金经理、东方互联网嘉混合型证券投资基金基金经理、东方创新科技混合型证券投资基金基金经理。

王然女士，权益研究部副总经理，投资决策委员会委员。北京交通大学产业经济学硕士，12年证券从业经历。曾任益民基金交通运输、纺织服装、轻工制造行业研究员。2010年4月加盟本公司，曾任权益投资部交通运输、纺织服装、商业零售行业研究员，东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于2015年8月7日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理助理、东方策略成长股票型开放式证券投资基金（于2015年8月7日转型为东方策略成长混合型开放式证券投资基金）基金经理、东方赢家保本混合型证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金（于2017年5月11日转型为东方成长收益平衡混合型证券投资基金）基金经理、东方荣家保本混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安定期开放混合型证券投资基金（于2017年9月13日起转型为东方民丰回报赢安混合型证券投资基金）基金经理、东方成长收益平衡混合型证券投资基金（于2018年1月17日转型为东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金）基金经理、东方大健康混合型证券投资基金基金经理、东方成长收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方价值挖掘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理，现任东方策略成长混合型开放式证券投资基金基金经理、东方新兴成长混合型证券投资基金基金经理、东方新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方民丰回报赢安混合型证券投资基金基金经理、东方盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东方城镇消费主题混合型证券投资基金基金经理。

吴萍萍女士，固定收益投资部副总经理，投资决策委员会委员。中国人民大学应用经济学硕士，9年证券从业经历。曾任安信证券投资组资金交易员、民生加银基金管理有限公司专户投资经理。2015年11月加盟本公司，曾任东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理助理、东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理助理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理助理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金（于2019年8月2日起转型为东方成长回报平衡混合型证券投资基金）基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方成长回报平衡混合型证券投资基金基金经理、东方臻悦纯债债券型证券投资基金基金经理、东方合家保本混合型证券投资基金基金经理，现任东方永兴18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方臻选纯债债券型证券投资基金基金经理、东方永泰纯债1年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方添益债券型证券投资基金基金经理、东方臻享纯债债券型证券投资基金基金经理、东方卓行18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东方永悦18个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理、东方臻萃 3 个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理。

6.上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金托管人

（一）基金托管人概况

名称：上海银行股份有限公司（以下简称"上海银行"）
住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号
法定代表人：金煜
成立时间：1995年12月29日
组织形式：股份有限公司（中外合资、上市）
注册资本：人民币142.065287亿元
存续期间：持续经营
基金托管业务批准文号：中国证监会 证监许可[2009]814号
托管部门联系人：周直毅
电话：021－68475608
传真：021－68476936

上海银行成立于1995年12月29日，是一家由国有股份、中资法人股份、外资股份及个人股份共同组成的股份制商业银行，总行位于上海， 是上海证券交易所主板上市公司，股票代码601229。

上海银行以"精品银行"为战略愿景，以"精诚至上，信义立行"为核心价值观，近年来通过推进专业化经营和精细化管理，着力在中小企业、财富管理和养老金融、金融市场、跨境金融、在线金融等领域培育和塑造经营特色，不断增强可持续发展能力。

上海银行目前在上海、北京、深圳、天津、成都、宁波、南京、杭州、苏州、无锡、绍兴、南通、常州、盐城等城市设立分支机构，形成长三角、环渤海、珠三角和中西部重点城市的布局框架；发起设立四家村镇银行、上银基金管理有限公司、上海尚诚消费金融股份有限公司，设立上海银行（香港）有限公司，并与全球120多个国家和地区近1500多家境内外银行及其分支机构建立了代理行关系。

上海银行自成立以来市场影响力不断提升。2018年上海银行被首批纳入MSCI指数，并被纳入上证公司治理、上证180公司治理、上证社会责任指数。在英国《银行家》杂志2019年度发布的"全球银行1000强" 榜单中，按照一级资本排名，上海银行位居第68位，较上一年度上升8位。近年来，上海银行在该榜单中排名连年提升。国际评级机构穆迪投资者服务公司授予上海银行的长期发行人和长期存款评级从"Baa3"上调至"Baa2"，短期发行人和短期存款评级从"Prime-3"上调至"Prime-2"，评级展望稳定。反映出上海银行资本实力不断增强，盈利能力稳步提高，资产质量同业领先。

截至2019年12月末，上海银行资产总额22,370.82亿元，较上年末增长10.32%，存款总额（不含应计利息）为11,860.71亿元，较上年末增长13.77%；客户贷款和垫款总额为9,725.05亿元，较上年末增长14.32%；拨备覆盖率337.15%，较上年末提高4.20个百分点。

（二）主要人员情况

上海银行总行下设资产托管部，是从事资产托管业务的职能部门，内设托管产品部、托管运作部、行管运作部、稽核监督部、系统管理部，平均年龄30岁左右，100%员工拥有大学本科以上学历，业务岗位人员均具有基金从业资格。

（三）基金托管业务经营情况

上海银行于2009年8月18日获得中国证监会、中国银监会核准开办证券投资基金托管业务，批准文号：中国证监会证监许可[2009]814号。

截至2020年3月末，上海银行已托管46只证券投资基金，分别为天治新消费灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）、中证财通中国可持续发展100（ECPI ESG）指数增强型证券投资基金、鹏华双债增利债券型证券投资基金、浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金、鹏华双债保利债券型证券投资基金、前海开源事件驱动灵活配置混合型发起式证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、中银安心回报半年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金、华安添颐混合型发起式证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、博时裕荣纯债债券型证券投资基金、浙商惠盈纯债债券型证券投资基金、兴业福益债券型证券投资基金、大成慧成货币市场证券投资基金、嘉实稳瑞纯债债券型证券投资基金、嘉实稳祥纯债债券型证券投资基金、博时裕弘纯债债券型证券投资基金、万家瑞富灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞尧灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞舜灵活配置混合型证券投资基金、永赢荣益债券型证券投资基金、长江可转债债券型证券投资基金、建信中债3-5年国开行债券指数证券投资基金、国融融信消费严选混合型证券投资基金、博时悦楚纯债债券型证券投资基金、平安惠聚纯债债券型证券投资基金、大成中债1-3年国开行债券指数增强型证券投资基金、蜂巢添幂中短债债券型证券投资基金、博时富进纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、广发景富纯债债券型证券投资基金、富国汇远纯债三年定期开放债券型证券投资基金、兴业中证银行50金融债指数证券投资基金、融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中欧同益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、博时富洋纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长城泰利纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、银华中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城泰申回报债券型证券投资基金、南方宁利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、博时稳悦63个月定期开放债券型证券投资基金和浦银安盛盛晖一年定期开放债券型发起式证券投资基金，资产净值合计928.78亿元。

（四）基金托管人的内部风险控制制度说明

1.内部控制目标

严格遵守国家有关法律法规、行业监管规章和上海银行有关规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2.内部控制组织结构

上海银行基金托管业务内部风险控制组织结构是由总行风险管理部门和资产托管部共同组成。托管业务风险控制纳入全行的风险管理体系；资产托管部配备专职人员负责托管业务内控稽核工作，各业务部室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3.内部控制的原则

①全面性原则：监督制约必须渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖到资产托管部所有的部室、岗位和人员。

②独立性原则：资产托管部内设独立的稽核监督团队，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：各业务部室在内部组织结构上形成相互制约，建立不同岗位之间的制衡体系。

④审慎性原则：内控与风险管理必须以防范风险、审慎经营为前提，保证托管资产的安全与完整；托管业务经营管理必须按照"内控优先"的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设。

⑤有效性原则：内部控制体系应与所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。

4.内部控制制度及措施

①建立明确的岗位职责、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建立托管业务前后台分离，不同岗位相互牵制的管理结构。

③专门的稽核监督人员组织各业务部室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

④托管业务操作间实施门禁管理和音像监控。

⑤定期开展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制定完备的应急预案，并组织员工定期演练；建立异地灾备，保证业务连续不中断。

（五）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

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人有违反法律法规和基金合同的行为，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。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，立即报告中国证监会，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。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1.直销机构

①柜台交易

名称：东方基金管理股份有限公司直销中心
住所：北京市西城区锦什坊街28号1－4层
法定代表人：崔伟
办公地址：北京市西城区锦什坊街28号3层
联系人：史鹏浩
电话：010－66295921
传真：010－66578690
网站：www.orient－fund.com或www.df5888.com

②电子交易

投资者可以通过本基金管理人网上交易系统等办理基金的认购、申购、赎回等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录本基金管理人网站查询。

本基金管理人网址：www.orient－fund.com 或www.df5888.com

2.其他销售机构

其他销售机构详见本基金基金份额发售公告或基金管理人届时发布的关于销售机构的相关公告。

（二）登记机构

名称：东方基金管理股份有限公司
住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层
办公地址：北京市西城区锦什坊街28号1-4层
法定代表人：崔伟
联系人：张力苍
电话：010－66295874
传真：010－66578680
网址：www.orient-fund.com或www.df5888.com

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：俞卫锋
联系人：陆奇
电话：021-31358666
传真：021-31358600
经办律师：黎明、陆奇

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：立信会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市南京东路61号4楼
办公地址：北京市海淀区西四环中路16号院7号楼10层
法定代表人：朱建弟
联系人：朱锦梅
电话：010－68286868
传真：010－88210608
经办注册会计师：朱锦梅、高慧丽

五、基金名称和基金类型

（一）本基金名称：东方臻慧纯债债券型证券投资基金
（二）本基金类型：债券型基金
（三）基金运作方式：契约型、开放式

六、基金的投资目标和投资方向

（一）投资目标

本基金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定增值。

（二）投资范围

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括债券（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、次级债）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、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）。

本基金不投资于股票资产，也不投资于可转换债券、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：本基金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的5%。

当法律法规的相关规定变更时，基金管理人可根据法律法规的规定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，优选具有投资价值的个券，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。

1、类属资产配置策略

鉴于各券种的收益率变化和利差变化的影响因素存在差异，且各经济阶段内的各券种波动性特征也存在不同，本基金通过综合分析、比较各券种的利差变化趋势、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）信用债券投资策略

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

2、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降低时，本基金将延长所持有的债券组合的久期，从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升所产生的资本利得；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。

3、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，适当的采取骑乘策略、子弹策略、杠铃策略、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取收益。具体来看：

（1）骑乘策略是当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。

（2）子弹策略是使投资组合中债券久期集中于收益率曲线的一点，适用于收益率曲线较陡时；杠铃策略是使投资组合中债券的久期集中在收益率曲线的两端，适用于收益率曲线两头下降较中间下降更多的蝶式变动；梯式策略是使投资组合中的债券久期均匀分布于收益率曲线，适用于收益率曲线水平移动。

4、资产支持证券投资策略

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

5、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，采用流动性好、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。

八、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债总全价指数收益率

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得收益，力争获取相对稳健的回报，追求基金资产的长期稳定增值。中债总全价指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，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，或者有更权威的、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、费用概览

（一）管理费率：

本基金的管理费每日按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。

（二）托管费率：

本基金的托管费每日按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。

（三）C类基金份额的销售服务费率

本基金A类基金份额不收取销售服务费；

本基金C类基金份额的销售服务费每日按前一日C类基金资产净值的0.10%的年费率计提。

十一、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关规定以及《东方臻慧纯债债券型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动进行了更新，主要内容如下：

（一）本公司改制为股份有限公司，名称变更为"东方基金管理股份有限公司"。

（二）在"第三部分 基金管理人"部分，更新了基金管理人的相关内容。

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

东方基金管理股份有限公司
2020年8月