东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
二〇一四年十二月十七日
【重要提示】

东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集申请经中国证监会2014 年12月2日证监许可【2014】1293号文准予注册。

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投资价值和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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及基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,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,自行承担投资风险。投资者在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,可能包括: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、封闭期无法赎回和开放期大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金资产净值连续60 个工作日基金份额持有人数量不满200人或者低于5000万元基金合同提前终止的风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的“卖者尽责、买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

本基金投资于中小企业私募债券,由于中小企业私募债券采取非公开发行的方式发行,即使在市场流动性比较好的情况下,个别债券的流动性可能较差,从而使得基金在进行个券操作时,可能难以按计划买入或卖出相应的数量,或买入卖出行为对价格产生比较大的影响,增加个券的建仓成本或变现成本。并且,中小企业私募债信用等级较一般债券较低,存在着发行人不能按时足额还本付息的风险,此外,当发行人信用评级降低时,基金所投资的债券可能面临价格下跌风险。

本基金是一只混合型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

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》”)、《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》”)和其他有关法律法规的规定,以及《东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称 “基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了本基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项,投资者在做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内容、误导性陈述或重大遗漏,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。本招募说明书由上海东方证券资产管理有限公司解释。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,或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书是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当事人之间权利、义务的法律文件。招募说明书主要向投资者披露与本基金相关事项的信息,是投资者据以选择及决定是否投资于本基金的要约邀请文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额,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,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。

二、释义

在本招募说明书中,除非文意另有所指,下列词语或而称具有如下含义:

1、 基金或本基金:指依据《基金合同》所募集的东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金
2、 基金管理人:指上海东方证券资产管理有限公司
3、 基金托管人:指中国光大银行股份有限公司
4、 基金合同、《基金合同》:指《东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效的修订和补充
5、 托管协议:指基金管理人与基金托管人签订的《东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充
6、 招募说明书或本招募说明书:指《东方红睿阳灵活配置混合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《东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告》
8、 上市交易公告书:指《东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金上市交易公告书》
9、 法律法规:指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件及其制定机构所作出的修订、补充和有权解释
10、《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, 并经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
11、《销售办法》:指中国证券监督管理委员会第28次主席办公会议于2013年2月17日修订通过、自2013年6月1日起实施的《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
12、《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
13、《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
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、个人投资人:指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人
18、机构投资人: 指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立的并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
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的可投资于中国境内合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:指个人投资人、机构投资人、合格境外机构投资者和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总称
21、基金份额持有人:指根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资人
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、代销机构:指基金管理人以及符合《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,以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位。其中,可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的机构必须是具有基金销售业务资格,并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的深圳证券交易所会员单位
24、场外:指不利用深圳证券交易所交易系统,而通过各销售机构柜台系统或其他交易系统进行基金份额认购、申购和赎回的场所
25、场内:指通过深圳证券交易所内的会员单位利用深圳证券交易所交易系统进行基金份额认购、申购、赎回以及上市交易的场所
26、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和办理非交易过户等
27、基金注册登记机构: 指上海东方证券资产管理有限公司或其委托的符合条件的办理基金注册登记业务的机构
28、注册登记系统:指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统,通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在注册登记系统
29、证券登记结算系统:指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统,通过场内会员单位认购、申购或通过上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统
30、开放式基金账户:指投资人通过场外销售机构在中国证券登记结算有限责任公司注册的开放式基金账户,用于记录投资人持有基金管理人管理的证券投资基金份额情况的账户
31、深圳证券账户:指投资人在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券交易所人民币普通股票账户或证券投资基金账户
32、基金交易账户:指各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基金申购、赎回、转换及转托管等业务所引起的基金份额的变动及结余情况的账户
33、基金合同生效日:指基金募集达到法律规定及《基金合同》约定的条件,基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续,获得中国证监会书面确认之日
34、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
35、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
36、基金存续期:指《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间
37、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
38、T日:指申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
39、T+n 日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)
40、封闭期:本基金封闭期为三年(含三年),自基金合同生效之日起至三年后对应日前一个工作日止。在封闭期内不开放申购、赎回业务,但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。封闭期届满后,本基金转换为上市开放式基金(LOF)
41、开放日:指本基金转换为上市开放式基金(LOF)后,销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日
42、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
43、《业务规则》:指《中国证券登记结算有限责任公司开放式证券投资基金及证券公司集合资产管理计划份额登记及资金结算业务指南》以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司其他适用于证券投资基金的业务规则
44、认购:指在本基金募集期内投资人根据基金合同和招募说明书的规定购买本基金基金份额的行为
45、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
46、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
47、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
48、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
49、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
50、巨额赎回:指在单个开放日,本基金的基金份额净赎回申请(赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额) 超过上一日本基金总份额的10%时的情形
51、元:指中国法定货币人民币元
52、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及因运用基金财产带来的成本和费用的节约
53、基金资产总值:指基金所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
54、基金资产净值:指基金资产总值扣除负债后的净资产值
55、基金份额净值:指估值日基金资产净值除以估值日基金份额总数的数值
56、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
57、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
58、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
59、基金销售网点:指基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点
60、货币市场工具:指现金;一年以内(含一年)的银行存款(包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款)、大额存单;剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券;期限在一年以内(含一年)的债券回购;期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具

三、基金管理人

(一)基金管理人概况

本基金基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基本信息如下:

名称:上海东方证券资产管理有限公司
住所:上海市中山南路318号2号楼31层
办公地址:上海市中山南路318号2号楼31层
法定代表人:王国斌
设立日期:2010年7月28日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可字[2010]518号
开展公开募集证券投资基金业务批准文号:证监许可[2013]1131号
组织形式:有限责任公司
注册资本:3亿元人民币
存续期限:持续经营
联系电话:(021)63325888
股东情况:东方证券股份有限公司持有公司100%的股权。

公司前身是东方证券股份有限公司客户资产管理业务总部,2010年7月28日经中国证券监督管理委员会《关于核准东方证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》(证监许可[2010]518号)批准,由东方证券股份有限公司出资3亿元, 在原东方证券股份有限公司客户资产管理业务总部的基础上正式成立,是国内首家获批设立的券商系资产管理公司。

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

王国斌先生,董事长,1968年生,中共党员,硕士研究生。曾任上海万国证券公司投资银行部融资经理;申银万国证券公司国际业务部融资经理;中国经济开发信托投资公司证券交易部总经理助理;东方证券有限责任公司交易总部副总经理、总裁助理兼交易总部总经理、总裁助理兼证券投资业务总部总经理;东方基金有限责任公司总裁;东方证券股份有限公司受托资产投资决策委员会执行委员(公司副总裁序列)兼受托资产管理业务总部总经理、副总裁兼受托资产管理业务总部总经理;现任东方证券股份有限公司副总裁、上海东方证券资产管理有限公司董事长。

潘鑫军先生,董事,1961年出生,中共党员,研究生学历,高级经济师。曾任中国人民银行上海分行长宁区办事处愚园路分理处出纳、副组长;工商银行上海分行长宁区办事处愚园路分理处党支部书记;工商银行上海分行整党办公室联络员,工商银行上海分行组织处副主任科员;工商银行上海分行长宁支行工会主席、副行长(主持工作)、行长、党委书记兼国际机场支行党支部书记;东方证券股份有限公司党委副书记、总裁、董事长兼总裁,现任东方证券股份有限公司党委书记、董事长,上海东方证券资本投资有限公司董事长、汇添富基金管理有限公司董事长、东方花旗证券有限公司董事长、上海东方证券资产管理有限公司董事。

金文忠先生,董事,1964年出生,中共党员,硕士研究生,经济师。曾任上海财经大学财经研究所研究员、上海万国证券办公室主任助理、发行部副经理(主持工作)、研究所副所长、总裁助理兼总裁办公室副主任;野村证券企业现代化委员会项目室副主任;东方证券股份有限公司党委委员、副总裁。现任东方证券股份有限公司党委副书记、总裁,上海东方证券创新投资有限公司董事长、杭州东方银溶投资管理有限公司董事长、上海东证期货有限公司董事、上海东方证券资产管理有限公司董事、上海东方证券资本投资有限公司董事、东方金融控股(香港)有限公司董事、东方花旗证券有限公司董事。

杨玉成先生,董事,1965年出生,中共党员,硕士研究生,高级经济师。曾任上海财经大学财政系教师;君安证券有限公司证券投资部总经理助理;上海大众科技创业(集团)股份有限公司董事、副总经理;上海申能资产管理有限公司董事、副总经理;东方证券股份有限公司财务总监、副总裁;申能集团财务有限公司董事、总经理;东方证券股份有限公司副总裁;现任东方证券股份有限公司副总裁、董事会秘书,东方金融控股(香港)有限公司董事长、上海东方证券资产管理有限公司董事、上海诚毅新能源创业投资有限公司董事。

陈光明先生,董事,1974年生,中共党员,硕士研究生。曾任东方证券受托资产管理业务总部业务董事;东方基金有限责任公司投资部经理兼基金经理;东方证券资产管理业务总部副总经理、总经理;现任东方证券股份有限公司总裁助理,上海东方证券资产管理有限公司董事、总经理。

2、基金管理人监事

顾林福先生,监事,1956年生,中共党员,研究生,经济师。曾任上海市教育局办事员、科员、副处长、上海市教育委员会副处长;现任上海市教育发展有限公司总经理,兼任上海交大昂立股份有限公司监事长。

3、经营管理层人员

陈光明先生,总经理(简历请参见上述关于董事的介绍)。

任莉女士,联席总经理,1968年生,北京大学社会学学士,美国芝加哥伊利诺州立大学社会学硕士、芝加哥大学工商管理硕士。曾任中央音乐学院教师;深圳工业品集团业务主管;深圳新药特药有限责任公司总经理助理;安诚医药有限责任公司副总经理;莊生莊臣公司高级分析员;北美医药公司副总经理;东方基金有限责任公司市场总监;亚洲环球有限责任公司副总经理;东方证券股份有限公司资产管理业务总部副总经理;现任上海东方证券资产管理有限公司联席总经理、董事会秘书。

4、合规总监

李进安先生,合规总监,1968年生,中共党员,博士研究生,注册会计师,律师。曾任江西省吉安地区财政局财干校讲师;深圳中诚会计师事务所注册会计师;君安证券稽核部高级稽核师;君安证券南京业务部总经理;国泰君安证券南京太平南路营业部总经理、江苏区总协调人;国泰君安证券总裁办公室、BPR常务副主任;东吴证券有限责任公司总规划师、副总裁;东方证券股份有限公司合规负责人、总裁助理兼风险管理总部总经理;现任东方证券股份有限公司首席风控官、合规总监、上海东方证券资产管理有限公司合规总监。

5、公开募集基金管理业务合规负责人(督察长)

钱慧女士,公开募集基金管理业务合规负责人兼合规与风险管理部总监,1978年出生,上海财经大学经济学硕士。曾任东方证券股份有限公司稽核部稽核员、稽核主管、合规与风险管理总部风险经理;上海东方证券资产管理有限公司风控主管、合规与风险管理部部门副总监(主持工作)、合规与风险管理部总监;现任公开募集基金管理业务合规负责人兼合规与风险管理部总监。

6、本基金基金经理

现任基金经理:林鹏先生,生于1976年,上海财经大学工商管理硕士研究生。1998年加入东方证券股份有限公司, 担任研究所研究员;2004年担任东方证券股份有限公司资产管理业务总部投资经理;2010年东方证券股份有限公司资产管理业务总部获监管部门批准成立上海东方证券资产管理有限公司,历任投资部投资经理,现任东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

7、基金业务投资决策委员会成员

基金投资决策委员会成员构成如下:公司总经理陈光明先生,研究部总监杨达治先生,基金经理林鹏先生。

列席人员:公募基金合规负责人兼合规与风险管理部总监钱慧女士。

8、上述人员之间不存在近亲属关系。

(三)基金管理人的职责

1、依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的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基金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,不得利用基金财产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、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,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

10、编制季度、半年度和年度基金报告;

11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露义务;

12、保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、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,不向他人泄露;

13、按《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基金收益;

14、按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

15、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;

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15 年以上;

17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

18、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;

19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

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时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

21、当基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失,而基金管理人首先承担了责任的情况下,基金管理人有权向第三方追偿;

23、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实施其他法律行为;

24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;

25、执行生效的基金份额持有人大会的决定;

26、建立并保存基金份额持有人名册;

27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

3、基金托管人简况

(7)玩忽职守,不按照规定履行职责;

(8)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、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)越权或违规经营;

(2)违反基金合同或托管协议;

(3)故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益;

(4)在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;

(5)拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;

(6)玩忽职守、滥用职权;

(7)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,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

(8)违反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;

(9)贬损同行,以提高自己;

(10)在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;

(11)以不正当手段谋求业务发展;

(12)有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;

(13)其他法律、行政法规禁止的行为。

(五)基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

1、承销证券;

2、违反规定向他人贷款或提供担保;

3、从事承担无限责任的投资;

4、向基金管理人、基金托管人出资;

5、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;

6、法律、行政法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(六)基金经理承诺

1、依照有关法律法规和《基金合同》的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

2、不能利用职务之便为自己、受雇人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,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

(七)基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

(1)健全性原则。内部控制应当包括基金管理人的各项业务、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。基金管理人各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立,基金管理人基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

2、内部控制的组织架构

基金管理人根据有关法律法规和章程的规定,建立了规范的治理机构和议事规则,明确了决策、执行、监督等方面的职责权限,形成了科学有效的职责分工和制衡机制。董事会、监事、经营管理层能够根据公司章程以及有关议事规则运行并行使职权。

基金管理人设董事会,对股东负责。董事会有5名董事组成,设董事长1人。董事会下设合规与风险管理委员会。基金管理人制定董事会议事规则,规定了董事会会议的召开及表决程序和职责等。

基金管理人设监事一名。公司监事依照法律及章程的规定负责检查财务和合规管理;对董事、总经理及其他高级管理人员执行职务时违反法律、法规或者章程的行为进行监督;督促落实风险管理体系的建立和实施及相关事项的整改;并就涉及基金管理人风险的重大事项向股东汇报。

经营管理层负责组织实施董事会决议,主持基金管理人的经营管理工作,负责经营管理中风险管理工作的日常运行。负责董事会授权范围内重大经营项目和创新业务的风险评估和决策。基金管理人已制定《上海东方证券资产管理有限公司总经理工作会议议事规则》,对公司总经理办公会议的种类及程序做出了明确规定。经营管理层下设投资决策委员会、产品委员会、风险控制委员会、信息技术战略发展和治理委员会,并分别制定了相应的议事规则,对各项重大业务及投资进行决策与风险控制。

3、内部控制制度

内部控制制度指规范内部控制的一系列规章制度和又务规则,是内部控制的重要组成部分。内部控制制度制订的基本依据为法律法规、中国证监会及其他主管部门有关文件的规定。内部控制制度分为四个层次:

(1)《公司章程》——指经股东批准的《公司章程》,是基金管理人制定各项基本管理制度和具体管理规章的指导性文件;

(2)内部控制大纲——是对《公司章程》规定的内部控制原则的细化和展开,是各项基本管理制度的纲要和总揽;

(3)公司基本管理制度——是基金管理人在经营管理宏观方面进行内部控制的制度依据。基本管理制度须经董事会审议并批准后实施。基本管理制度包括但不限于风险管理制度、投资管理制度、基金会计核算办法、信息披露办法、监察稽核制度、信息技术管理制度、业绩评估考核制度和危机处理制度等;

(4) 部门规章制度以及业务流程——部门规章制度以及业务流程是在公司基本管理制度的基础上,对各部门的主要职责,岗位设置、岗位责任、操作守则等的具体说明。它不仅是基金管理人的业务、管理、监督的需要,同时也是避免工作中主管随意性的有效手段。部门制度及具体管理规章根据总经理办公会的决定进行拟订、修改,经总经理办公会批准后实施的。制定的依据包括法律法规、证监会规定和《公司章程》及公司基本管理制度。

4、基金管理人关于内部控制的声明

(1)本基金管理人承诺以上内部控制的披露真实、准确。

(2)本基金管理人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。

(3)本基金管理人承诺将积极配合外部风险监督工作。

四、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

1、基本情况

名称:中国光大银行股份有限公司(简称“中国光大银行”)
住所:北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
法定代表人:唐双宁
联系电话:010-63639739
传真:010-63639132
联系人:林迈
客服电话:95595
网址:www.cebbank.com

(2)东方证券股份有限公司

注册地址: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21层-29层
法定代表人:潘鑫军
联系电话:(021)63325888
联系人:胡月茹
客服电话:(021)95503
公司网站:www.dfzq.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

3. 场内销售机构

本基金的场内销售机构为具有基金销售资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的的深圳证券交易所会员单位,具体名单请详见深圳证券交易所网站(http://www.szse.cn/)。

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
电话:010-58598853
传真:010-58598907
联系人:任瑞新

(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:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
负责人:俞卫锋
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:孙睿
经办律师:黎明、孙睿

(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)
注册地址:上海市黄浦区南京东路61号4楼
办公地址:上海市黄浦区南京东路61号4-11楼
法人代表:朱建弟
经办注册会计师:朱颖、尤文杰
电话:021- 63392558
传真:021- 63391166
联系人:尤文杰

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他有关规定募集,募集申请经中国证监会2014 年12 月2 日证监许可【2014】1293号文准予注册。

(一)基金类型

混合型证券投资基金。

(二)基金运作方式

契约型基金

本基金基金合同生效后,在封闭期内不开放申购、赎回业务,但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。封闭期届满后,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。

本基金基金合同生效后,封闭期为三年(含三年),封闭期届满后转换为上市开放式基金(LOF)。本基金封闭期目基金合同生效之日起至三年后对应日的前一工作日。

基金管理人有权在封闭期届满前召集基金份额持有人大会,审议是否在封闭期届满后延长封闭期及延长封闭期的期限,具体事项由基金管理人另行公告。

(三)基金存续期限

不定期。

(四)募集期限

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月,募集时间见基金份额发售公告。

基金管理人有权根据基金募集的实际情况按照相关程序延长或缩短募集期,此类变更适用于所有销售机构。基金募集期若延长,最长不得超过前述募集期。

(五)基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

1、发售时间

自基金份额发售之日起不超过3个月,具体发售时间见基金份额发售公告。

2、发售方式

基金募集期内,基金份额通过各销售机构的基金销售网点向投资人公开发售,投资人可通过场内认购和场外认购两种方式认购本基金。场外发售渠道包括基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点(具体名单见基金份额发售公告);场内发售渠道为通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的深圳证券交易所会员单位(具体名单见基金份额发售公告)。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提前发售基金份额。

通过场外认购的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下;通过场内认购的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。

本基金认购采取全额缴款认购的方式。投资人在募集期内可多次认购,认购一经受理不得撤销。

基金发售机构认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表发售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。投资者可在《基金合同》生效后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的基金份额。

3、发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资人、机构投资人及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。

(六)发售渠道

本基金的场外认购将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售(具体名单详见基金份额发售公告)。本基金的场内认购将通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的的深圳证券交易所会员单位(具体名单详见深圳证券交易所网站(http://www.szse.cn/)。

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
电话:010-58598853
传真:010-58598907
联系人:任瑞新

(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:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
负责人:俞卫锋
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:孙睿
经办律师:黎明、孙睿

(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)
注册地址:上海市黄浦区南京东路61号4楼
办公地址:上海市黄浦区南京东路61号4-11楼
法人代表:朱建弟
经办注册会计师:朱颖、尤文杰
电话:021- 63392558
传真:021- 63391166
联系人:尤文杰

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他有关规定募集,募集申请经中国证监会2014 年12 月2 日证监许可【2014】1293号文准予注册。

(一)基金类型

混合型证券投资基金。

(二)基金运作方式

契约型基金

本基金基金合同生效后,在封闭期内不开放申购、赎回业务,但投资人可在本基金上市交易后通过深圳证券交易所转让基金份额。封闭期届满后,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。

本基金基金合同生效后,封闭期为三年(含三年),封闭期届满后转换为上市开放式基金(LOF)。本基金封闭期目基金合同生效之日起至三年后对应日的前一工作日。

基金管理人有权在封闭期届满前召集基金份额持有人大会,审议是否在封闭期届满后延长封闭期及延长封闭期的期限,具体事项由基金管理人另行公告。

(三)基金存续期限

不定期。

(四)募集期限

自基金份额发售之日起最长不得超过3个月,募集时间见基金份额发售公告。

基金管理人有权根据基金募集的实际情况按照相关程序延长或缩短募集期,此类变更适用于所有销售机构。基金募集期若延长,最长不得超过前述募集期。

(五)基金份额的发售时间、发售方式、发售对象

1、发售时间

自基金份额发售之日起不超过3个月,具体发售时间见基金份额发售公告。

2、发售方式

基金募集期内,基金份额通过各销售机构的基金销售网点向投资人公开发售,投资人可通过场内认购和场外认购两种方式认购本基金。场外发售渠道包括基金管理人的直销中心及代销机构的代销网点(具体名单见基金份额发售公告);场内发售渠道为通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的深圳证券交易所会员单位(具体名单见基金份额发售公告)。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提前发售基金份额。

通过场外认购的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下;通过场内认购的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。

本基金认购采取全额缴款认购的方式。投资人在募集期内可多次认购,认购一经受理不得撤销。

基金发售机构认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表发售机构确实接收到认购申请。认购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。投资者可在《基金合同》生效后到各销售网点查询最终成交确认情况和认购的基金份额。

3、发售对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资人、机构投资人及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。

(六)发售渠道

本基金的场外认购将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售(具体名单详见基金份额发售公告)。本基金的场内认购将通过深圳证券交易所交易系统办理本基金销售业务的的深圳证券交易所会员单位(具体名单详见深圳证券交易所网站(http://www.szse.cn/)。

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
电话:010-58598853
传真:010-58598907
联系人:任瑞新

(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:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
负责人:俞卫锋
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:孙睿
经办律师:黎明、孙睿