

信息披露

Disclosure

(上接B065版)

法定代表人:刘惠
联系人:毛林
联系电话:021-80133597
传真:021-80133413
客服电话:400-808-1016
网址:www.fundshin.com.cn
64、上海联泰资产管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人:燕斌
联系人:陈东
联系电话:021-52822063
传真:021-52575270
客服电话:4000-466-788
网址:www.66zichan.com
65、北京汇成基金销售有限公司
住所:北京市海淀区中关村大街11号A座1108
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号A座1108
法定代表人:王伟刚
联系人:丁明坤
联系电话:010-66292140
传真:010-62890282
客服电话:400-619-9069
网址:www.fundzone.cn
66、凤凰基金(银川)投资管理有限公司
住所:宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402号公用房
办公地址:银川市朝阳区广场中街甲1号 朝来高科技产业园5号楼
法定代表人:张刚
联系人:张旭
联系电话:010-58160168
传真:010-58160181
客服电话:400-810-5919
网址:www.fengfund.com
67、乾道泰基金销售有限公司(北京)有限公司
住所:北京市海淀区东北旺村南1号楼7层717室
办公地址:北京市西城区德外大街合生财富广场1302室
法定代表人:关光吉
联系人:高雪璐
联系电话:010-62062880
传真:010-82057741
客服:400-088-8080
网址:www.qiandaojr.com
68、深圳富济财富管理有限公司
住所:深圳市南山区粤海街道科苑南路高新七道惠恒集团二期418室
办公地址:深圳市南山区粤海街道科苑南路高新七道惠恒集团二期418室
法定代表人:齐小华
联系人:马伟伟
电话:0755-83999097-815
传真:0755-83999026
客户服务电话:0756-8399907
网址:www.jinjiawo.com
69、北京南瑞瑞财投资管理有限公司
住所:北京市海淀区中关村东路66号102-06
办公地址:北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街八号京东集团总部
法定代表人:江卉
联系人:万蓉
电话:18910325400
传真:010-58198289
客户服务电话:个人业务:95118, 400 098 8511 企业业务:400 088 8816
网址:www.kuon.com
70、上海基煜基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
办公地址:上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人:李雄
联系人:王鑫
电话:021-65370077
传真:021-60800791
客户服务电话:400-820-5369
网址:www.jiyuntund.com
71、一路财富(北京)信息科技股份有限公司
住所:北京市西城区阜成门内大街2号1幢A2208室
办公地址:北京市西城区阜成门内大街2号1幢A2208室
法定代表人:吴雪涛
联系人:徐越
电话:010-88312877
传真:010-88312879
客服电话:400-001-1566
网址:www.yilucaifu.com
72、上海华夏财富投资管理有限公司
住所:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人:毛振平
联系人:仲伙明
电话:010-88066632
传真:010-63136189
客户服务电话:400-617-5666
网址:www.huaxiawallet.com
73、嘉实财富管理有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单
元
办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层
法定代表人:赵学军
联系人:余永健
电话:010-85097570
传真:010-85097308
客户服务电话:400-021-8850
网址:www.harvestwm.cn
74、上海中正达广基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙大道2815号302室
办公地址:上海市徐汇区龙大道2815号302室
联系人:戴妮妮
电话:021-33769132
传真:021-33769132*902
客户服务电话:400-6767-523
网址:www.zzhwz.com.cn
75、类金融基金销售有限公司(深圳)有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市福田区海德三道航钛科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TEO WEE HOWE
联系人:叶健
电话:0755-89460507
传真:0755-26167463
客户服务电话:400-684-0560
网址:www.laifund.com.cn
76、深圳前海理惠基金销售有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市福田区海德三道航钛科技广场A座17楼1704室
法定代表人:高峰
联系人:李勇
电话:0755-83656588
传真:0755-83656158
客户服务电话:400-804-8688
网址:www.keyuansse.com.cn
77、武汉市伯嘉基金销售有限公司
住所:湖北省武汉市江岸区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第7栋22层14号
办公地址:湖北省武汉市江岸区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第7栋22层14号,4号
法定代表人:李捷
联系人:孔繁
电话:027-87006003*8020
电话:027-87006010
客户服务电话:400-027-9899
网址:www.baijiafund.com
78、济安财富(北京)基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼4046室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层
联系人:李海婧
电话:010-65306069
传真:010-65306099
客服电话:400-673-7010
网址:www.jianfortune.com
79、金惠家保险代理有限公司
住所:北京市海淀区东升园公寓1号楼1层南部
办公地址:北京市朝阳区门外大街18号丰联广场A座1009
联系人:胡胡胡
电话:15810201340
传真:028-62825388
客服电话:400-8567333
网址:www.jhihome.com
80、和合顺投资有限公司
住所:山西省太原市迎泽区菜园东街2号
办公地址:山西省太原市迎泽区菜园东街2号
联系人:张基甲
电话:0351-7342798
传真:0351-7342538
客服电话:0351-7342798
网址:www.jinhhgh.com.cn
81、天津市凤凰财富基金销售有限公司
住所:天津市和平区南京路181号世纪都会1606-1607
办公地址:天津市和平区南京路181号世纪都会1606-1607
联系人:孟媛媛
电话:18920017760
传真:022-23287867
客户服务电话:400-706-6880
网址:www.bicf.com
82、泰诚财富基金销售有限公司(大连)有限公司
住所:辽宁省大连市沙河口区星海广场3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海广场3号
联系人:徐江
电话:18840800358
客服电话:400-0411-001
网址:www.haojijin.com.cn
83、北京恒泰基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区东三环北路1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区东三环北路1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人:姜爱波
联系人:姜爱波
电话:18610561064
客服电话:400-159-9288
网址:danjiafund.com

84、中民财富基金销售有限公司(上海)有限公司

住所:上海市黄浦区中山东路100号7层06单元

办公地址:上海市浦东新区民生路1199号世纪大道五道口广场1号楼27层

法定代表人:洪洪军
联系人:黄刚
电话:18521506916
客服电话:400-876-5716
网址:www.cmiwm.com
85、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:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:王磊
联系人:马国兴
电话:17626037552
客服电话:025-66969699
网址:www.snjfund.com
86、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号楼
办公地址:西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10号楼
法定代表人:陈宏
联系人:廖少俊
电话:021-23686876
客服电话:95357
网址:www.18.cn
(三)登记机构
名称:东方基金管理有限责任公司
住所:北京市西城区锡什坊街28号1-4层
办公地址:北京市西城区锡什坊街28号1-4层
法定代表人:崔伟
联系人:李进康
电话:010-66296874
传真:010-66576800
网址:www.orient-fund.com或www.dft888.com
(四)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:韩炯
联系人:黎明
电话:021-31358666
传真:021-31358600
经办律师:黎明、孙晋
(五)审计会计师事务所
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:010-88296988
传真:010-88210088
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:东方安心收益保本混合型证券投资基金
(二)本基金类型:混合型
(三)基金运作方式:契约型、开放式
六、基金投资目标及投资方向
(一)投资目标
本基金通过固定收益类资产与风险资产的动态配置和有效的组合管理,控制本金损失的风险,并在本金安全的基础上实现基金资产的稳定增值。
(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,主要投资于固定收益类金融工具,包括国债、中央银行票据、地方政府债、金融债(含政策性金融债)、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转债)、次级债、资产支持证券、债券回购、银行存款等金融工具;以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它固定收益类金融工具。本基金也可投资于法律法规允许上市交易的股票(包括科创板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)以及经中国证监会核准发行的其它权益类金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。
如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。
基金的投资组合比例为:
本基金将根据CPPI固定比例投资组合保险策略,将投资对象主要分为固定收益类资产和风险资产两类,动态调整两类资产的投资比例,从而达到防御下跌、实现增值的目的。其中,固定收益类资产包括国债、中央银行票据、地方政府债、金融债(含政策性金融债)、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它固定收益类金融工具;中风险资产包括股票、权证、可转换债券(含可分离交易可转债)等权益类资产;其中股票等风险资产占基金资产的比例不高于40%,固定收益类资产占基金资产的比例不低于60%,其中基金保留的现金(不含结算备付金、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、投资于权证的比例不超过基金资产净值的3%。
如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围,有关投资比例限制等遵循届时有效的规定执行。

七、基金的投资策略

本基金将综合运用固定比例投资组合保险策略(Constant Proportion

Portfolio Insurance,以下简称CPPI策略)与基于期权的投资组合保险策略

(Option-Based Portfolio Insurance,以下简称OBPI策略)在保本周期内实现

保值增值的目的。

在大类资产配置方面,本基金将主要运用CPPI策略来动态调整资产在风险资产

和固定收益类资产上的投资比例,并根据对未来市场形势的分析判断,动态调整

风险资产中股票、债券、商品、大宗商品等资产的投资比例,以期通过持有相当数量

的剩余风险小于或等于保本周期的债券等低风险固定收益类证券,并规避利率、再投

资等风险,以确保固定收益类资产的稳定收益。

在风险资产投资方面,以追求收益为目的,即采用积极投资方式,把握市场机

会,挖掘市场热点,精选个股,获取稳定的资本增值。

CPPI组合保险机制

CPPI策略最早由Black and Jones在1987年提出,并于上世纪90年代以后

成为保本型基金重要的交易策略之一。

其核心思想是将本金投入到低风险资产和高风险资产,通过投资固定收益

类资产实现保本目标,投资高风险资产谋求本金的增值,如图1所示。

其中,固定收益类资产主要投资于到期日与保本周期到期日相当的国债、企业

债与金融债等低风险资产,确保基金在保本周期到期时,基金资产实现保本目标;

而高风险资产主要投资于股票、权证等较高风险资产以博取更高的收益。

图1 CPPI策略下的本金保障

图1展示了CPPI策略下的本金保障,图中横轴为时间,纵轴为资产净值,图中

展示了保本周期到期时,资产净值不低于本金的情况。

为了尽可能地分享股票等高风险资产品种在价格上涨时所带来的收益,资产

管理人在运用CPPI策略进行投资管理时,通常会根据对证券市场的判断,放大风

险资产的投资额度,如下列公式所述:

其中,CPPI为CPPI系数,CPPI=1+ (A-B)/C,其中A为资产净值, B为保本

本金, C为资产净值与保本本金的差额,即: C=A-B。

当C>0时,CPPI>1,此时基金资产净值高于保本本金,基金管理人可适度放

大高风险资产的投资比例,以期获得更高的收益。

当C=0时,CPPI=1,此时基金资产净值等于保本本金,基金管理人应保持

高风险资产的投资比例不变,以保持资产净值等于保本本金。

当C<0时,CPPI<1,此时基金资产净值低于保本本金,基金管理人应适当

降低高风险资产的投资比例,以确保资产净值不低于保本本金。

第二,计算基金资产净值超过当前最低要保障额的数值,该数值即为安全

垫。

第三,将安全垫放一定的倍数(风险乘数),将相当于该数值的资金投资于

风险资产以博取高于最低要保障额的收益,其余资产投资于固定收益类资产。

即:在保本周期内任一时间(t),可投资于风险资产的额度为:

其中,CPPI为CPPI系数,CPPI=1+ (A-B)/C,其中A为资产净值, B为保本

本金, C为资产净值与保本本金的差额,即: C=A-B。

当C>0时,CPPI>1,此时基金资产净值高于保本本金,基金管理人可适度放

大高风险资产的投资比例,以期获得更高的收益。

当C=0时,CPPI=1,此时基金资产净值等于保本本金,基金管理人应保持

高风险资产的投资比例不变,以保持资产净值等于保本本金。

当C<0时,CPPI<1,此时基金资产净值低于保本本金,基金管理人应适当

降低高风险资产的投资比例,以确保资产净值不低于保本本金。

第二,计算基金资产净值超过当前最低要保障额的数值,该数值即为安全

垫。

第三,将安全垫放一定的倍数(风险乘数),将相当于该数值的资金投资于

风险资产以博取高于最低要保障额的收益,其余资产投资于固定收益类资产。

即:在保本周期内任一时间(t),可投资于风险资产的额度为:

其中,CPPI为CPPI系数,CPPI=1+ (A-B)/C,其中A为资产净值, B为保本

本金, C为资产净值与保本本金的差额,即: C=A-B。

当C>0时,CPPI>1,此时基金资产净值高于保本本金,基金管理人可适度放

大高风险资产的投资比例,以期获得更高的收益。

当C=0时,CPPI=1,此时基金资产净值等于保本本金,基金管理人应保持

高风险资产的投资比例不变,以保持资产净值等于保本本金。

当C<0时,CPPI<1,此时基金资产净值低于保本本金,基金管理人应适当

降低高风险资产的投资比例,以确保资产净值不低于保本本金。

第二,计算基金资产净值超过当前最低要保障额的数值,该数值即为安全

垫。

第三,将安全垫放一定的倍数(风险乘数),将相当于该数值的资金投资于

风险资产以博取高于最低要保障额的收益,其余资产投资于固定收益类资产。

即:在保本周期内任一时间(t),可投资于风险资产的额度为:

其中,CPPI为CPPI系数,CPPI=1+ (A-B)/C,其中A为资产净值, B为保本

本金, C为资产净值与保本本金的差额,即: C=A-B。

当C>0时,CPPI>1,此时基金资产净值高于保本本金,基金管理人可适度放

大高风险资产的投资比例,以期获得更高的收益。

当C=0时,CPPI=1,此时基金资产净值等于保本本金,基金管理人应保持

高风险资产的投资比例不变,以保持资产净值等于保本本金。

当C<0时,CPPI<1,此时基金资产净值低于保本本金,基金管理人应适当

降低高风险资产的投资比例,以确保资产净值不低于保本本金。

第二,计算基金资产净值超过当前最低要保障额的数值,该数值即为安全

垫。

第三,将安全垫放一定的倍数(风险乘数),将相当于该数值的资金投资于

风险资产以博取高于最低要保障额的收益,其余资产投资于固定收益类资产。

即:在保本周期内任一时间(t),可投资于风险资产的额度为:

其中,CPPI为CPPI系数,CPPI=1+ (A-B)/C,其中A为资产净值, B为保本

本金, C为资产净值与保本本金的差额,即: C=A-B。

当C>0时,CPPI>1,此时基金资产净值高于保本本金,基金管理人可适度放

大高风险资产的投资比例,以期获得更高的收益。

当C=0时,CPPI=1,此时基金资产净值等于保本本金,基金管理人应保持

高风险资产的投资比例不变,以保持资产净值等于保本本金。

当C<0时,CPPI<1,此时基金资产净值低于保本本金,基金管理人应适当

降低高风险资产的投资比例,以确保资产净值不低于保本本金。

第二,计算基金资产净值超过当前最低要保障额的数值,该数值即为安全

垫。

第三,将安全垫放一定的倍数(风险乘数),将相当于该数值的资金投资于

风险资产以博取高于最低要保障额的收益,其余资产投资于固定收益类资产。

即:在保本周期内任一时间(t),可投资于风险资产的额度为:

其中,CPPI为CPPI系数,CPPI=1+ (A-B)/C,其中A为资产净值, B为保本

本金, C为资产净值与保本本金的差额,即: C=A-B。

当C>0时,CPPI>1,此时基金资产净值高于保本本金,基金管理人可适度放

大高风险资产的投资比例,以期获得更高的收益。

当C=0时,CPPI=1,此时基金资产净值等于保本本金,基金管理人应保持

高风险资产的投资比例不变,以保持资产净值等于保本本金。

当C<0时,CPPI<1,此时基金资产净值低于保本本金,基金管理人应适当

降低高风险资产的投资比例,以确保资产净值不低于保本本金。

第二,计算基金资产净值超过当前最低要保障额的数值,该数值即为安全

垫。

第三,将安全垫放一定的倍数(风险乘数),将相当于该数值的资金投资于

风险资产以博取高于最低要保障额的收益,其余资产投资于固定收益类资产。

即:在保本周期内任一时间(t),可投资于风险资产的额度为:

其中,CPPI为CPPI系数,CPPI=1+ (A-B)/C,其中A为资产净值, B为保本

本金, C为资产净值与保本本金的差额,即: C=A-B。

当C>0时,CPPI>1,此时基金资产净值高于保本本金,基金管理人可适度放

大高风险资产的投资比例,以期获得更高的收益。

当C=0时,CPPI=1,此时基金资产净值等于保本本金,基金管理人应保持

高风险资产的投资比例不变,以保持资产净值等于保本本金。

当C<0时,CPPI<1,此时基金资产净值低于保本本金,基金管理人应适当

降低高风险资产的投资比例,以确保资产净值不低于保本本金。

第二,计算基金资产净值超过当前最低要保障额的数值,该数值即为安全

垫。

第三,将安全垫放一定的倍数(风险乘数),将相当于该数值的资金投资于

风险资产以博取高于最低要保障额的收益,其余资产投资于固定收益类资产。

即:在保本周期内任一时间(t),可投资于风险资产的额度为:

其中,CPPI为CPPI系数,CPPI=1+ (A-B)/C,其中A为资产净值, B为保本

本金, C为资产净值与保本本金的差额,即: C=A-B。

当C>0时,CPPI>1,此时基金资产净值高于保本本金,基金管理人可适度放

大高风险资产的投资比例,以期获得更高的收益。

当C=0时,CPPI=1,此时基金资产净值等于保本本金,基金管理人应保持

高风险资产的投资比例不变,以保持资产净值等于保本本金。

当C<0时,CPPI<1,此时基金资产净值低于保本本金,基金管理人应适当

降低高风险资产的投资比例,以确保资产净值不低于保本本金。

第二,计算基金资产净值超过当前最低要保障额的数值,该数值即为安全

垫。

第三,将安全垫放一定的倍数(风险乘数),将相当于该数值的资金投资于

风险资产以博取高于最低要保障额的收益,其余资产投资于固定收益类资产。

即:在保本周期内任一时间(t),可投资于风险资产的额度为:

其中,CPPI为CPPI系数,CPPI=1+ (A-B)/C,其中A为资产净值, B为保本

本金, C为资产净值与保本本金的差额,即: C=A-B。

当C>0时,CPPI>1,此时基金资产净值高于保本本金,基金管理人可适度放

大高风险资产的投资比例,以期获得更高的收益。

当C=0时,CPPI=1,此时基金资产净值等于保本本金,基金管理人应保持

高风险资产的投资比例不变,以保持资产净值等于保本本金。

当C<0时,CPPI<1,此时基金资产净值低于保本本金,基金管理人应适当

降低高风险资产的投资比例,以确保资产净值不低于保本本金。

第二,计算基金资产净值超过当前最低要保障额的数值,该数值即为安全

垫。

第三,将安全垫放一定的倍数(风险乘数),将相当于该数值的资金投资于

风险资产以博取高于最低要保障额的收益,其余资产投资于固定收益类资产。

即:在保本周期内任一时间(t),可投资于风险资产的额度为:

其中,CPPI为CPPI系数,CPPI=1+ (A-B)/C,其中A为资产净值, B为保本

本金, C为资产净值与保本本金的差额,即: C=A-B。

当C>0时,CPPI>1,此时基金资产净值高于保本本金,基金管理人可适度放

大高风险资产的投资比例,以期获得更高的收益。

当C=0时,CPPI=1,此时基金资产净值等于保本本金,基金管理人应保持

高风险资产的投资比例不变,以保持资产净值等于保本本金。

当C<0时,CPPI<1,此时基金资产净值低于保本本金,基金管理人应适当

降低高风险资产的投资比例,以确保资产净值不低于保本本金。

第二,计算基金资产净值超过当前最低要保障额的数值,该数值即为安全

垫。

第三,将安全垫放一定的倍数(风险乘数),将相当于该数值的资金投资于