东方红京东大数据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）

东方红京东大数据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 2015 年 6 月 17 日证监许可【2015】1275 号文准予注册。本基金的基金合同于 2015 年 7 月 31 日正式生效。

【重要提示】

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、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险、本基金特有的风险等。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，中小企业私募债券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，其预期风险与预期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。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写。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。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，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》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

本招募说明书所载内容截止至2018年7月30日，基金投资组合报告截止至2018年6月30日（财务数据未经审计）。

一、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：上海市黄浦区中山南路318号31层

办公地址：上海市黄浦区中山南路318号2号楼31、37、39、40层

授权代表：潘鑫军

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[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

联系人：廉迪

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

潘鑫军先生，董事长，1961 年出生，中共党员，工商管理硕士，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，汇添富基金管理有限公司董事长，上海东方证券资本投资有限公司董事长，东方金融控股（香港）有限公司董事。现任东方证券股份有限公司党委书记、董事长、执行董事，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长。

金文忠先生，董事，1964 年出生，中共党员，经济学硕士，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、证券投资业务总部总经理，杭州东方银帝投资管理有限公司董事长，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。现任东方证券股份有限公司党委副书记、执行董事、总裁，上海东证期货有限公司董事长，上海东方证券资本投资

有限公司董事长，上海东方证券创新投资有限公司董事，上海东方证券资产管理有限公司董事。

杜卫华先生，董事，1964 年出生，中共党员，工商管理学硕士、经济学硕士，副教授。曾任上海财经大学金融学院教师，东方证券股份有限公司营业部经理，经纪业务总部总经理助理、副总经理，营运管理总部总经理，人力资源管理总部总经理，总裁助理，职工监事。现任东方证券股份有限公司副总裁、工会主席、纪委委员，上海东方证券资本投资有限公司董事，上海东方证券创新投资有限公司董事，上海东方证券资产管理有限公司董事。

任莉女士，董事、总经理、公开募集基金管理业务负责人、财务负责人、董事会秘书，1968 年出生，社会学硕士、工商管理硕士。拥有十多年海内外市场营销经验，曾任东方证券股份有限公司资产管理业务总部副总经理，上海东方证券资产管理有限公司总经理助理、副总经理、联席总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司董事、总经理、公开募集基金管理业务负责人、财务负责人、董事会秘书、合规总监兼首席风险官（代行）、公开募集基金管理业务合规负责人（代行）。

杨斌先生，董事，1972 年出生，中共党员，经济学硕士。曾任中国人民银行上海分行非银行金融机构管理处科员，上海证监局稽查处科员、案件审理处科员、副主任科员、案件调查一处主任科员、机构监管一处副处长、期货监管处处长、法制工作处处长；现任东方证券股份有限公司首席风险官兼合规总监兼稽核总部总经理、上海东证期货有限公司董事、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、上海东方证券资产管理有限公司董事。

2、基金管理人监事

陈波先生，监事，1971 年出生，中共党员，经济学硕士。曾任东方证券投资银行业务总部副总经理，东方证券股份有限公司上市办副主任、上海东方证券资本投资有限公司副总经理（主持工作）。现任上海东方证券资本投资有限公司董事、总经理，上海东方证券资产管理有限公司监事。

3、经营管理层人员

任莉女士，总经理（简历请参见上述关于董事的介绍）。

饶刚先生，副总经理，1973 年出生，硕士研究生。曾任兴业证券职员，富国基金管理有限公司研究员、固定收益部总经理兼基金经理、总经理助理，富国

资产管理（上海）有限公司总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理兼公募固定收益投资部总经理。曾荣获中证报 2010 年金牛特别基金经理奖（唯一固定收益获奖者）、2012 年度上海市金融行业领军人才，在固定收益投资领域具有丰富的经验。

周代希先生，副总经理，1980 年出生，中共党员，硕士研究生。曾任深圳证券交易所会员管理部经理、金融创新实验室高级经理、固定收益与衍生品工作小组执行经理，兼任深圳仲裁委员会仲裁员。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理。曾荣获“证券期货监管系统金融服务能手”称号等，在资产证券化等结构融资领域具有丰富的经验。

卢强先生，副总经理，1973 年出生，中共党员，硕士研究生。曾任冶金部安全环保研究院五室项目经理，华夏证券武汉分公司投资银行部业务董事，长信基金管理有限公司客户服务部客服总监、综合行政部行政总监，中欧基金管理有限公司基金销售部销售总监，海通证券客户资产管理部市场总监，上海东方证券资产管理有限公司渠道发展部总监兼机构业务部总监、执行董事、董事总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理兼市场部总经理。

张锋先生，副总经理，1974 年出生，硕士研究生。曾任上海财政证券公司研究员，兴业证券股份有限公司研究员，上海融昌资产管理有限公司研究员，信诚基金管理有限公司股票投资副总监、基金经理，上海东方证券资产管理有限公司基金投资部总监、执行董事、董事总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理兼私募权益投资部总经理，拥有丰富的证券投资经验。

林鹏先生，副总经理，1976 年出生，硕士研究生。曾任东方证券研究所研究员、资产管理业务总部投资经理，上海东方证券资产管理有限公司投资部投资经理、专户投资部资深投资经理、基金投资部基金经理、执行董事、董事总经理。现任上海东方证券资产管理有限公司副总经理兼公募权益投资部总经理，拥有丰富的证券投资经验。

4、合规总监、首席风险官

任莉女士，首席风险官兼合规总监（代行）（简历请参见上述关于董事的介绍）。

5、公开募集基金管理业务合规负责人（督察长）

任莉女士，公开募集基金管理业务合规负责人（代行）（简历请参见上述关

于董事的介绍）。

6、本基金基金经理

（1）现任基金经理

周云先生，出生于1982年，清华大学生物学博士。自2008年起开始从事证券行业工作，历任东方证券股份有限公司资产管理业务总部研究员，上海东方证券资产管理有限公司研究部高级研究员、投资主办人，权益研究部高级研究员、投资主办人，现任公募权益投资部副总经理、基金经理。2015年9月起担任东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金和东方红新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年6月起担任东方红睿满沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年4月起担任东方红智逸沪港深定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2018年1月起担任东方红睿泽三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

（2）历任基金经理

杨达治先生，2015年7月至2016年1月任东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

7、公募产品投资决策委员会成员

公募产品投资决策委员会成员构成如下：主任委员饶刚先生，委员林鹏先生，委员刚登峰先生，委员纪文静女士，委员周云先生。

列席人员：任莉女士。

8、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83 号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于 2002 年 3 月成功地发行了 15 亿 A 股，4 月 9 日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股，9 月 22 日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10 月 5 日行使 H 股超额配售，共发行了 24.2 亿 H 股。截至 2018 年 3 月 31 日，集团总资产 62,522.38 亿元人民币，高级法下资本充足率 15.51%，权重法下资本充足率 12.79%。

2002 年 8 月，招商银行成立基金托管部；2005 年 8 月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室 5 个职能处室，现有员工 81 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利

ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展,社会影响力不断提升,四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016 年 6 月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获奖项国内托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7 月荣膺 2016 年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”；2017 年 6 月再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，“全功能网上托管银行 2.0”荣获《银行家》2017 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8 月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”，2018 年 1 月获得中央国债登记结算有限责任公司 “2017 年度优秀资产托管机构”奖项，同月招商银行“托管大数据平台风险管理系统”荣获 2016-2017 年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3 月招商银行荣获公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖。。

（二）主要人员情况

李建红先生，董事长、非执行董事，2014 年 7 月起担任董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，行长、执行董事，2013 年 5 月起担任行长、执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于 2003 年 7 月至 2013 年 5 月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生，副行长，货币银行学硕士，高级经济师。1991 年至 1995 年，在中国科技国际信托投资公司工作；1995 年 6 月至 2001 年 10 月，历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理；2001 年 10 月至 2006 年 3 月，历任北京分行行长助理、副行长；2006

年3月至2008年6月，任北京分行党委书记、副行长（主持工作）；2008年6月至2012年6月，任北京分行行长、党委书记；2012年6月至2013年11月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记；2013年11月至2014年12月，任招商银行总行行长助理；2015年1月起担任副行长；2016年11月起兼任董事会秘书。

姜然女士，资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

（三）基金托管业务经营情况

截至2018年3月31日,招商银行股份有限公司累计托管364只开放式基金。

三、相关服务机构

（一）基金销售机构

1、直销机构

(1)直销中心

名称：上海东方证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路318号31层

办公地址：上海市黄浦区中山南路318号2号楼37层

授权代表：潘鑫军

联系电话：（021）33315895

传真：（021）63326381

联系人：廉迪

客服电话：4009200808

公司网址：www.dfham.com

（2）网上交易系统

网上交易系统包括管理人公司网站（www.dfham.com）、东方红资产管理APP和管理人指定且授权的电子交易平台。个人投资者可登录本公司网站（www.dfham.com）、东方红资产管理APP和管理人指定且授权的电子交易平台，在与本公司达成网上交易的相关协议、接受本公司有关服务条款、了解有关基金网上交易的具体业务规则后，通过本公司网上交易系统办理开户、认购、申购、赎回等业务。

2、代销机构

（1）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系电话：（0755）83198888

传真：（0755）83195050

联系人：邓炯鹏

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

（2）中国工商银行股份有限公司

注册地址：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

联系电话：（010）66108608

传真：（010）66107571

联系人：官学清

客户服务电话：95588

公司网站：www.icbc.com.cn

（3）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、23层、25层－29层

办公地址：上海市中山南路318号2号楼13层、21层－23层、25层－29层、32层、36层、39层、40层

法定代表人：潘鑫军

联系电话：（021）63325888

联系人：黄静

客服电话：（021）95503

公司网站：www.dfzq.com.cn

（4）上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路12号

办公地址：上海市北京东路689号

法定代表人：高国富

联系电话：（021）61618888

传真：（021）63230807

联系人：杨国平、吴蓉

客服电话：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

（5）中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街25号、甲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、甲25号中国光大中心

法定代表人：李晓鹏

联系电话：010-63636235

传真：010-63636713

联系人：张谔

客服电话：95595

网址：www.cebbank.com

（6）平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号

法定代表人：谢永林

联系电话：021-38637673

联系人：张莉

客服电话：95511

公司网站：www.bank.pingan.com

（7）上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路168号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人：金煜

联系电话：（021）68475888

传真：（021）68476111

联系人：王景斌

客服电话：95594

公司网站：www.bosc.cn

（8）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

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号天华信息科技园南区3C座7楼（天天基金）

法定代表人：其实

联系电话：021-54509988

传真：021-64385308

联系人：胡阅

客服电话：4001818188

公司网站：www.1234567.com.cn

（9）深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

法定代表人：薛峰

联系电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

联系人：童彩平

客服电话：4006788887

公司网站：www.zlfund.cn

（10）珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系电话：020-89629099

传真：020-89629011

联系人：黄敏嫦

客户服务电话：020-89629066

公司网站：www.yingmi.cn

（11）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

办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室

法定代表人：杨文斌

联系电话：（021）20211842

传真：(021) 68596916

联系人：黄琳

客服电话：4007009665

公司网站：www.ehowbuy.com

（12）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区金融大街25号

法定代表人：田国立

联系人：徐漫霞

电话：86-10-66215533

传真：010-66275654

客服电话：95533

公司网站：www.ccb.com

（13）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街2号凯恒中心B，E座3层

法定代表人：王常青

联系电话：010-85130628

传真：010-65182261

联系人：许梦园

客户服务电话：400-8888-108

公司网站：www.csc108.com

（14）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：陈四清

客户服务电话：95566

传真：010-66594946

公司网站： www.boc.cn

（15）北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部

法定代表人：江卉

联系人：赵德赛

客服电话：400-098-8511（个人业务）、400-088-8816（企业业务）

公司网站：http://kenterui.jd.com/

（16）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：彭纯

联系电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：陈铭铭

客服电话：95559

公司网站：www.bankcomm.com

（17）兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路154号

法定代表人：高建平

联系电话：021-52629999

联系人：李博

客服电话：95561

网址：www.cib.com.cn

（18）平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号

法定代表人：谢永林

联系电话：021-38637673

联系人：张莉

客服电话：95511

公司网站：www.bank.pingan.com

（19）嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15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

联系电话：021-38789658-5834

传真：021-68880023

联系人：王宫

客服电话：4000218850

网址：www.harvestwm.cn

（20）上海东证期货有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路500号上海期货大厦14层

办公地址：上海市黄浦区中山南路318号35层

法定代表人：卢大印

联系人：张敏圆

联系电话：021-63325888-4259

传真：021-63326752

客服电话：400-885-9999

网址：www.dzqh.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。

（二）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：赵亦清

（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：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼

法人代表：李丹

经办注册会计师：薛竞、陈熹

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：乐美昊

四、基金的名称

东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金根据公司大数据分析模型，进行行业配置和个股选择，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。

七、基金的投资方向

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、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、债券、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、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的相关规定)。

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。

本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%—95%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%，前述现金

不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

八、基金的投资策略

本基金是一只灵活配置的混合型基金，采取主动管理的投资模式。在投资策略上，管理人先根据宏观分析和市场判断确定大类资产的配置，然后充分利用公司大数据研究平台的优势，通过对京东大数据（包括京东电商的销量、浏览量、点击量、客户评价、客户收藏量等基础数据）的分析研究，先将原始行业数据进行深层次的加工、计算，建立各个行业的分析逻辑，再通过模型构造，建立起因子分析框架，然后挖掘数据形成因子，通过因子拟合趋势，进行回溯和验证，从而挖掘出不同行业的敏感因子，提取合成不同行业的观察指标，结合管理人线下的研究进行行业配置和个券选择，构建合理的投资组合。

1、资产配置

本基金通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合中权益类资产和固定收益类资产的配置比例。

本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标，确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在目标收益条件下，追求风险最小化目标，最终确定大类资产投资权重，实现资产合理配置。

2、股票组合的构建

本基金充分利用公司大数据研究平台的优势，通过对京东大数据（包括京东电商的销量、浏览量、点击量、客户评价、客户收藏量等基础数据）的分析研究，分析各行业现状和发展前景，选择重点行业，并结合各公司的管理水平、盈利模式等，选择重点个股。

（1）行业配置策略

本基金将结合线下实地调研和线上大数据挖掘研究进行行业配置。本基金通过线下调研进行行业竞争要素分析和定性判断，通过线上大数据进行行业趋势的挖掘和跟踪。结合线上和线下的分析，本基金可以判断细分行业的供需情况、价

格走势和消费者倾向等关键要素，从而确定各细分行业所处的发展阶段（如拐点期、快速成长期、周期成长期等）、竞争趋势、景气程度和发展空间等，找出成长性好，盈利空间大，处于上升趋势的行业进行重点投资。通过线上和线下相结合的分析也可以对拐点型行业做出较早的预判，提前做出布局，在行业的配置上占据主动优势。

（2）个股投资策略

个股选择方面，本基金将结合定性与定量分析方法精选个股。

定性分析方面，本基金将结合研究团队的资料研究（包括大数据分析）和实地调研，通过深入了解上市公司的经营主业、战略规划和长期发展前景，一方面对股票价值水平、成长能力进行研究筛选，把可持续成长且估值水平合理的上市公司作为本基金选择的一个重要方向，另一方面本基金也会考虑公司未来盈利空间和发展潜力，不仅仅拘泥于现有的盈利表现，更注重选择符合上述个股选择和行业配置的策略，着眼于长期发展，积极提前配置。

本基金的资料研究工作集中于收集如下方面的信息：

1）上市公司所属细分行业的产业政策和政策的变化趋势；

2）公司和行业所拥有的核心技术和技术壁垒的高低，技术成熟度，以及技术演变的趋势，是否会出现颠覆性的新技术；

3）调研上市公司及其产品的市场需求情况、市场供给情况，供需格局和竞争结构，进入壁垒和退出壁垒的高低，以及是否会出现行业外的跨产业竞争者；

4）利用公司大数据研究平台的优势，运用京东大数据对上市公司所属细分行业的数据进行挖掘和分析：包括价格趋势和斜率、销量趋势和斜率、地域分布、人群特点等要素以及这些要素之间的相关性分析。从而判断对行业的趋势、斜率、空间等等，结合上市公司在行业中的地位，对公司的短、中、长期趋势做出判断。

5）研究公司所处行业中各种不同商业模式的竞争和演化，分析公司的核心商业模式，及该商业模式的稳定性和可持续性。

本基金实地调研上市公司也将围绕上述内容展开，除收集信息外，也是与已收集资料的互相验证，在实地调研的过程中，本基金研究团队将通过结合多种信息渠道进行信息的搜集比较，包括但不限于上市公司的多个部门、行业专家、政策制定机构、行业协会、上游供应商、下游客户、竞争对手等。

定量分析则是基于公司运营、财务等数据建立指标评价体系，考察公司盈利

能力、负债水平、营运能力等，具体指标为：

1）财务指标：毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率等；

2）估值指标：市盈率（PE）、市销率（PS）、股息率、息税前收入与企业价值的比等；

3)成长性指标：每股收益（EPS）增长、主营业务收入增长、净资产收益率（ROE）增长率等。

3、债券等其他固定收益类投资策略

本基金的固定收益类投资品种主要有国债、企业债等中国证监会认可的，具有良好流动性的金融工具。固定收益投资主要用于提高非股票资产的收益率，管理人将坚持价值投资的理念，严格控制风险，追求合理的回报。

在债券投资方面，管理人将以宏观形势及利率分析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价。

4、中小企业私募债券投资策略

由于中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。在进行投资时，将采取分散投资、锁定收益策略。在遴选债券时，将只投资有担保或者国有控股企业发行的中小企业私募债，以降低信用风险。

5、资产支持证券投资策略

本基金资产支持证券的投资配置策略主要从信用风险、流动性、收益率几方面来考虑，采用自下而上的项目精选策略，以资产支持证券的优先级或次优级为投资标的，精选违约或逾期风险可控、收益率较高的资产支持证券项目。根据不同资产支持证券的基础资产采取适度分散的地区配置策略和行业配置策略，在有效分散风险的前提下为投资人谋求较高的投资组合回报率。资产支持证券的信用风险分析采取内外结合的方法，以基金管理人的内部信用风险评估为主，并结合外部信用评级机构的分析报告，最终得出对每个资产支持证券项目的总体风险判断。另外，鉴于资产支持证券的流动性较差，本基金更倾向于久期较短的品种，即使持有到期压力也不会太大。

6、股指期货投资策略

本基金投资股指期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益。

7、国债期货投资策略

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率*70%+中国债券总指数收益率*30%。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金的投资组合报告

以下投资组合报告数据截至2018年6月30日。

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	2,157,308,190.66	80.17
	其中：股票	2,157,308,190.66	80.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	26,814,935.00	1.00
	其中：债券	26,814,935.00	1.00
	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	-	-
	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	233,282,253.37	8.67
8	其他资产	273,415,379.01	10.16
9	合计	2,690,820,758.04	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2、 报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	41,629,886.98	1.56
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,466,510,461.78	54.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.00
E	建筑业	35,424,340.00	1.32
F	批发和零售业	184,490,928.40	6.90
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,471,013.00	0.88
J	金融业	102,130,154.86	3.82
K	房地产业	37,177,060.00	1.39
L	租赁和商务服务业	177,140,367.14	6.62
M	科学研究和技术服务业	450,157.95	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	88,812,260.70	3.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,157,308,190.66	80.64

（2）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）

1	002470	金正大	29,500,000	202,960,000.00	7.59
2	600887	伊利股份	5,694,877	158,887,068.30	5.94
3	002027	分众传媒	15,361,821	142,675,226.97	5.33
4	600060	海信电器	10,298,348	137,894,879.72	5.15
5	000333	美的集团	2,449,694	127,923,020.68	4.78
6	600976	健民集团	5,513,204	115,722,151.96	4.33
7	002475	立讯精密	5,000,000	112,700,000.00	4.21
8	603001	奥康国际	9,431,339	112,327,247.49	4.20
9	600143	金发科技	18,834,888	98,318,115.36	3.68
10	600267	海正药业	6,400,000	93,056,000.00	3.48

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	26,814,935.00	1.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	26,814,935.00	1.00

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	110034	九州转债	254,170	26,814,935.00	1.00

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股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期未进行股指期货投资。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期未进行国债期货投资。

（3）本期国债期货投资评价

本基金本报告期未进行国债期货投资。

11、投资组合报告附注

（1）本基金持有的海正药业（代码：600267）发行主体浙江海正药业股份有限公司（以下简称“公司”），因公司披露 2016 年度业绩预告不准确、重大合同披露不及时不完整等问题，2017 年 12 月 8 日上海证券交易所发布《关于对浙江海正药业股份有限公司及有关责任人予以纪律处分的决定》（〔2017〕74 号），对浙江海正药业股份有限公司和时任董事会秘书邓久发、时任财务总监管旭华予以公开谴责，对时任董事长白骅、时任总裁林剑秋、时任审计委员会召集人孟晓俊予以通报批评。

本基金对上述证券的投资决策程序符合基金合同及公司制度的相关规定，本基金管理人会对上述证券继续保持跟踪研究。

本基金持有的前十名证券中其余九名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

（2）基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	496,488.15
2	应收证券清算款	268,281,610.43
3	应收股利	-
4	应收利息	78,338.05
5	应收申购款	4,558,942.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	273,415,379.01

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110034	九州转债	26,814,935.00	1.00

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002027	分众传媒	72,031,200.00	2.69	大宗交易取得并带有限售期

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

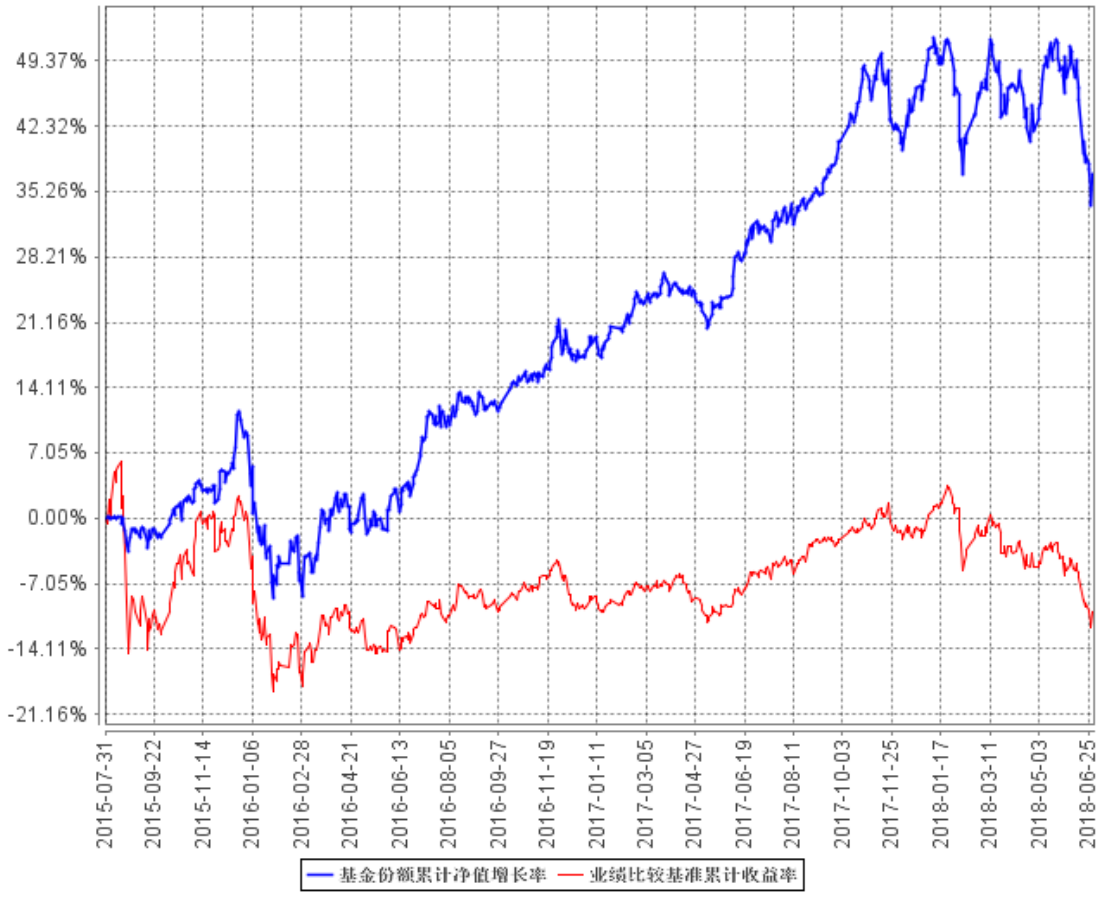
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

以下基金业绩数据截至 2018 年 6 月 30 日。

1、东方红京东大数据灵活配置混合型证券投资基金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

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
2015 年 7 月 31 日至 2015 年 12 月 31 日	9.00%	0.75%	-0.08%	1.70%	9.08%	-0.95%
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	8.35%	1.13%	-9.43%	1.07%	17.78%	0.06%
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	24.64%	0.56%	9.07%	0.46%	15.57%	0.10%
2015 年 7 月 31 日至 2018 年 6 月 30 日	37.20%	0.92%	-10.11%	0.99%	47.31%	-0.07%

2、自基金合同生效以来基金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：截止日期为2018年6月30日。

十三、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费；

（2）基金托管人的托管费；

（3）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

（4）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金的证券、期货交易费用；

（7）基金的银行汇划费用；

（8）证券、期货账户开户费和账户维护费；

（9）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.5%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式，于次月前3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式，于次月前3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述基金费用的种类中第3—9项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（3）证券账户开户费用：证券账户开户费经基金管理人与基金托管人核对无误后，自本基金成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付，如基金财产余额不足支付该开户费用，由基金管理人于产品成立一个月后的5个工作日内进行垫付，基金托管人不承担垫付开户费用义务。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费率

本基金对通过基金管理人直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

通过基金管理人直销中心申购的养老金客户的申购费率如下：

申购金额（M）	费率
M＜1000 万	0.30%
M≥1000 万元	每笔 1000 元

其他投资者申购本基金基金份额的申购费率如下：

申购金额（M）	费率
M＜1000 万	1.50%
M≥1000 万元	每笔 1000 元

本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

因红利自动再投资而产生的基金份额，不收取相应的申购费用。

2、赎回费率

本基金的赎回费率按持有时间递减。投资者在一天之内如果有多笔赎回，适

用费率按单笔分别计算。具体如下：

份额持续持有时间（L）	适用赎回费率
L<7 日	1.5%
7 日≤L<30 日	0.75%
30 日≤L<365 日	0.5%
365 日≤L<730 日	0.3%
L≥730 日	0

赎回费用由基金赎回人承担，对份额持续持有时间小于30日的，赎回费用全部归基金财产，对份额持续持有时间少于3个月的（1个月等于30日），赎回费用总额的75%归基金财产，对份额持续持有时间长于3个月但小于6个月的，赎回费用总额的50%归基金财产，对份额持续持有时间长于6个月的，赎回费用总额的25%归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定，在指定媒介公告。

4、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以在履行适当程序后，采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性，摆动定价机制的具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律组织的规定，具体见基金管理人届时的相关公告。

5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师

费、信息披露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率。

调高基金管理费率、基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议，本协议另有约定的除外；调低基金管理费率或基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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》及其他有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1、“重要提示”部分更新了招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期，增加了本基金单一投资者持有基金份额数的限制。

2、“一、绪言”部分将《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》纳入招募说明书编写依据。

3、“二、释义”部分新增《流动性风险管理规定》、流动性受限资产、摆动定价机制的释义。

4、“三、基金管理人”部分对基金管理人概况、主要人员情况等内容进行了更新。

5、“四、基金托管人”部分对基金托管人概况、基金托管业务经营情况、

托管人的内部控制制度、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进行了更新。

6、“五、相关服务机构”部分对基金销售机构、审计基金财产的会计师事务所的信息进行了更新。

7、“八、基金份额的申购、赎回与转换”部分更新了申购和赎回的数额限定、基金的申购费和赎回费、拒绝或暂停申购的情形、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形、巨额赎回的情形及处理方式。

8、“九、基金的投资”部分更新了本基金投资组合报告，内容截止至 2018 年 6 月 30 日，更新了投资范围、投资限制的内容。

9、更新了“十、基金的业绩”，内容截止至 2018 年 6 月 30 日。

10、“十二、基金资产的估值”部分更新了估值方法和暂停估值的情形。

11、“十四、基金的费用与税收”部分更新了与基金销售有关的费用。

12、“十六、基金的信息披露”部分更新了公开披露的基金信息的内容。

13、“十七、风险揭示”部分更新了本基金的主要流动性风险及管理方法。

14、“二十、托管协议的内容摘要”部分更新了基金托管协议当事人、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查的内容。

15、更新了“二十二、其他应披露事项”，内容为报告期内应披露的本基金其他相关事项。

上海东方证券资产管理有限公司

二〇一八年九月十日