（上接 C82 版）

客服电话：95584
公司网址：www.hx168.com.cn
(214) 公司名称：晋中银行股份有限公司
注册地址：山西省晋中市榆次区迎宾西街 65 号
办公地址：山西省晋中市榆次区迎宾西街 65 号
法定代表人：刘海滨
联系人：赵文元
联系电话：0354-3366398 18635431255
业务传真：0354-3366033
客服热线：95105678
公司网址：www.jzbank.com
(215) 公司名称：九江银行股份有限公司
注册地址：江西省九江市长虹大道 619 号
办公地址：江西省九江市长虹大道 619 号
法人：刘羡庭
联系人：纪淑平
联系电话：13970072990
传真：0792-8325029
客服电话：95316
网址：www.jjccb.com
(216)公司名称：上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室
办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼法人：陈继武
联系人：刘璐
联系电话：021-63333389
传真：021-63333390
客服电话：4006433389
网址：www.vstonewealth.com
(217)名称：联储证券有限责任公司
办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼
法定代表人：沙常明
联系电话：021-80295888
客服热线：400-620-6868
公司网址：www.lczq.com
(218)名称：齐商银行股份有限公司
法人：杲传勇
地址：淄博市张店区中心路 105 号
电话：0533-2178888
(219)名称：泰诚财富基金销售(大连)有限公司
注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号
法定代表人：林卓
联系人：薛长平
电话：0411-88891212
传真：0411-88891212
客服电话：400-0411-001
公司网址：www.haojiyoujijin.com
(220)名称：西部证券股份有限公司
注册地址：西安市新城区东新街 319 号 8 幢 10000 室
法定代表人：徐朝晖
联系人：梁采华
联系电话：029-87211526
业务传真：029-87211548
客服热线：95582
公司网址：www.westsecu.com
(221)名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街 3 号
办公地址：北京市西城区金融大街 3 号 A 座
法定代表人：李国华
客服电话：95580
网址：www.psbc.com
(222)公司名称：中国人寿保险股份有限公司
注册地址：中国北京市西城区金融大街 16 号
办公地址：中国北京市西城区金融大街 16 号
法定代表人姓名：王 滨
公司网址：www.e-chinalife.com
客服电话：95519
(223)名称：中信银行股份有限公司
住所：北京市东城区朝阳门北大街 9 号
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号
法定代表人：李庆萍
联系人：廉赵峰
联系电话：010-65557048
业务传真：010-65550827
客服热线：95558
公司网址：www.citicbank.com
(224)公司名称：中证金牛(北京)投资咨询有限公司
注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室
办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层
法人：钱昊旻
联系人：沈晨
联系电话：010-59336544
传真：010-59336586
客服电话：4008-909-998
网址：www.jnlc.com
(225)名称：广发期货有限公司
注册地址：广东省广州市黄埔区峻弦街 12 号 1002 房
办公地址：广东省广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 38 楼，41 楼，42 楼，43 楼
法人：罗满生
客服电话：95105826
公司网址：http://www.gfqh.com.cn
(226)公司名称：广东华兴银行股份有限公司
注册地址：广东省汕头市龙湖区黄山路 28 号四层
办公地址：广东省广州市天河路 533 号
法人：周泽荣
联系人：许悦
联系电话：020-38173552
传真：020-38173857
客服电话：4008308001
网址：www.ghbank.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、注册登记机构

A 类、B 类、C 类份额注册登记机构：
名称：广发基金管理有限公司
住所：广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室 -49848（集中办公区）
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 31-33 楼
法定代表人：孙树明
联系人：李尔华
电话：020-89188970
传真：020-89899175
E 类份额注册登记机构：
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
联系人：崔巍
电话：010-50938888
传真：010-59378907

三、律师事务所和经办律师

名称：广东广信君达律师事务所
住所：广州市天河区珠江新城珠江东路 6 号广州周大福金融中心 29 层、10 层
负责人：王晓华
电话：020－37181333
传真：020－37181388
经办律师：王晓华
联系人：刘智、杨琳

四、 会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
法人代表：毛鞍宁
电话：020－28812888
传真：020－28812618
经办注册会计师：赵雅、马婧

四、基金的名称

广发货币市场基金

五、基金的类型

货币市场基金

六、基金的投资目标

在保持低风险与资产流动性的基础上，追求稳定的当期收益。

七、基金的投资方向

1、现金；
2、期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款(包括活期存款、定期存款、通知存款、大额存单等)、债券回购、中央银行票据、同业存单；
3、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具(包括但不限于短期融资券、超短期融资券、中期票据)、资产支持证券；
4、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

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。其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

八、基金的投资策略

1. 决策依据

以《基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、本基金合同等有关法律法规为决策依据，并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

2. 投资管理的方法和标准

稳健的主动投资是本基金投资策略的总体特征。主动是相对被动投资而言，强调通过基金管理人主动管理为投资人控制风险和创造稳定收益。稳健是强调主动投资必须重视控制风险，要兼顾基金资产的流动性、安全性和收益性的目标。

具体而言，投资策略以自上而下为主，兼顾自下而上的方式。其中，自上而下是指基金管理人通过定量与定性相结合的综合分析，对利率尤其是短期利率的变化趋势进行预测，在科学、合理的短期利率预测的基础上决定本基金组合的期限结构和品种结构，构建稳健的投资组合。自下而上是指要重视具体投资对象的价值分析，同时针对市场分割及定价机制暂时失灵带来的投资机会，进行相应的套利操作，增加投资收益。具体策略如下：

(1)利率预测
(2)期限配置策略
(3)品种配置策略
(4)挖掘套利投资机会

3. 投资禁止

本基金不投资于以下金融工具：
(1)股票；
(2)可转换债券；
(3) 剩余期限超过三百九十七天的债券；
(4) 信用等级在 AAA 级以下的企业债券；
(5) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

九、业绩比较基准

根据本基金的投资对象和投资目标，本基金的业绩比较基准于 2010 年 10 月 26 日变更为税后活期存款利率：即(1－利息税率)×活期存款利率。

十、风险收益特征

本基金风险收益特征
1. 高安全性：本金损失的风险小，收益的波动性小；
2. 高流动性：基金投资组合本身剩余期限短，流动性高；投资人在基金交易时无需支付费用，变现成本低；
3. 稳定的收益：力争获取稳定的超过同期银行定期存款利率(税后)的收益率。

十一、投资组合报告

本基金管理人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，并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 12 月 5 日复核了本报告中的财务指标、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 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	固定收益投资	5,256,083,017.81	63.15
	其中：债券	5,256,083,017.81	63.15
	资产支持证券	－	－
2	买入返售金融资产	1,561,894,902.85	18.77
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	－
3	银行存款和结算备付金合计	1,357,479,002.02	16.31
4	其他资产	147,651,894.04	1.77
5	合计	8,323,108,816.72	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	6.77	
	其中：买断式回购融资	－	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	－	－
	其中：买断式回购融资	－	－

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

3、基金投资组合平均剩余期限

3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	77
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	79
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	54

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未发生超过 120 天的情况。

3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30 天以内	24.96	－
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	－	－
2	30 天(含)—60 天	19.86	－
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	－	－
3	60 天(含)—90 天	18.49	－
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	－	－
4	90 天(含)—120 天	14.03	－
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	－	－
5	120 天(含)—397 天(含)	21.33	－
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	－	－
	合计	98.67	－

4、报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过 240 天的情况。

5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	358,411,155.94	4.33
2	央行票据	－	－
3	金融债券	59,984,775.52	0.72
	其中：政策性金融债	59,984,775.52	0.72
4	企业债券	－	－
5	企业短期融资券	149,991,228.92	1.81
6	中期票据	－	－
7	同业存单	4,687,695,857.43	56.58
8	其他	－	－
9	合计	5,256,083,017.81	63.43
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	－	－

6、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111909014	19 浦发银行 CD014	5,000,000.00	495,366,363.12	5.98
2	111818308	18 华夏银行 CD308	4,000,000.00	399,197,750.43	4.82
3	111915433	19 民生银行 CD433	4,000,000.00	397,731,036.19	4.80
4	111984475	19 宁波银行 CD165	3,500,000.00	349,023,551.04	4.21
5	111906065	19 交通银行 CD065	3,500,000.00	345,199,234.54	4.17
6	199938	19 贴现国债 38	3,100,000.00	308,613,165.66	3.72
7	111921281	19 渤海银行 CD281	2,000,000.00	199,419,385.43	2.41
8	111999792	19 北京农商银行 CD102	2,000,000.00	198,745,417.89	2.40
9	111813158	18 浙商银行 CD158	1,500,000.00	149,517,525.64	1.80
10	011900617	19 东航股 SCP004	1,200,000.00	119,967,195.58	1.45

7、"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0 次
报告期内偏离度的最高值	0.0841%
报告期内偏离度的最低值	0.0202%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0424%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

9、投资组合报告附注

9.1 基金计价方法说明

本基金采用"摊余成本法"计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益。

9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国民生银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司和浙商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会(含原中国银行业监督管理委员会、中国保险监督管理委员会)或其派出机构的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	－
2	应收证券清算款	－
3	应收利息	8,295,885.93
4	应收申购款	139,356,008.11
5	其他应收款	－
6	待摊费用	－
7	其他	－
8	合计	147,651,894.04

十二、基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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。基金业绩数据截至 2019 年 6 月 30 日。

1、本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发货币 A：

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
2005.5.20-2005.12.31	1.1856%	0.0031%	1.1145%	0.0000%	0.0711%	0.0031%
2006.1.1-2006.12.31	1.7251%	0.0030%	1.8799%	0.0003%	-0.1548%	0.0027%
2007.1.1-2007.12.31	3.3134%	0.0081%	2.7850%	0.0019%	0.5284%	0.0062%
2008.1.1-2008.12.31	3.3637%	0.0117%	3.7877%	0.0013%	-0.4240%	0.0104%
2009.1.1-2009.12.31	1.2827%	0.0064%	2.1672%	0.0000%	-0.8845%	0.0064%
2010.1.1-2010.12.31	1.7904%	0.0026%	1.8515%	0.0019%	-0.0611%	0.0007%
2011.1.1-2011.12.31	4.1593%	0.0030%	0.4762%	0.0001%	3.6831%	0.0029%
2012.1.1-2012.12.31	4.2452%	0.0028%	0.4260%	0.0002%	3.8192%	0.0026%
2013.1.1-2013.12.31	4.1984%	0.0026%	0.3549%	0.0000%	3.8435%	0.0026%
2014.1.1-2014.12.31	4.8563%	0.0017%	0.3549%	0.0000%	4.5014%	0.0017%
2015.1.1-2015.12.31	3.6954%	0.0025%	0.3549%	0.0000%	3.3405%	0.0025%
2016.1.1-2016.12.31	2.5813%	0.0007%	0.3558%	0.0000%	2.2255%	0.0007%
2017.1.1-2017.12.31	3.5596%	0.0016%	0.3549%	0.0000%	3.2047%	0.0016%
2018.1.1-2018.12.31	3.6030%	0.0018%	0.3549%	0.0000%	3.2481%	0.0018%
2019.1.1-2019.6.30	1.2475%	0.0006%	0.1760%	0.0000%	1.0715%	0.0006%
自基金合同生效起至今	55.3405%	0.0054%	16.7941%	0.0031%	38.5464%	0.0023%

广发货币 B：

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
2009.4.20-2009.12.31	1.0555%	0.0070%	1.5200%	0.0000%	-0.4645%	0.0070%
2010.1.1-2010.12.31	2.0347%	0.0026%	1.8515%	0.0019%	0.1832%	0.0007%
2011.1.1-2011.12.31	4.4071%	0.0030%	0.4762%	0.0001%	3.9309%	0.0029%
2012.1.1-2012.12.31	4.4946%	0.0028%	0.4260%	0.0002%	4.0686%	0.0026%
2013.1.1-2013.12.31	4.4480%	0.0026%	0.3549%	0.0000%	4.0931%	0.0026%
2014.1.1-2014.12.31	5.1073%	0.0017%	0.3549%	0.0000%	4.7524%	0.0017%
2015.1.1-2015.12.31	3.9440%	0.0025%	0.3549%	0.0000%	3.5891%	0.0025%
2016.1.1-2016.12.31	2.8276%	0.0007%	0.3558%	0.0000%	2.4718%	0.0007%
2017.1.1-2017.12.31	3.8079%	0.0016%	0.3549%	0.0000%	3.4530%	0.0016%
2018.1.1-2018.12.31	3.8516%	0.0018%	0.3549%	0.0000%	3.4967%	0.0018%
2019.1.1-2019.6.30	1.3679%	0.0006%	0.1760%	0.0000%	1.1919%	0.0006%
自基金合同生效起至今	44.2465%	0.0039%	6.5798%	0.0018%	37.6667%	0.0021%

广发货币 C：

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
2017.8.17-2017.12.31	1.4787%	0.0008%	0.1332%	0.0000%	1.3455%	0.0008%
2018.1.1-2018.12.31	3.5977%	0.0018%	0.3549%	0.0000%	3.2428%	0.0018%
2019.1.1-2019.6.30	1.2481%	0.0006%	0.1760%	0.0000%	1.0721%	0.0006%
自基金合同生效起至今	6.4411%	0.0020%	0.6640%	0.0000%	5.7771%	0.0020%

广发货币 E

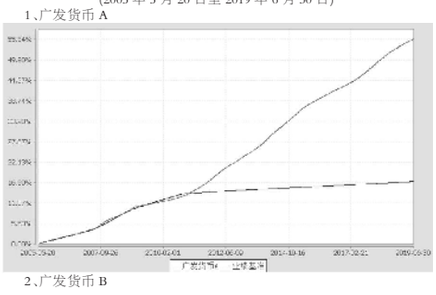
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016.3.15-2016.12.31	1.9216%	0.0008%	0.2839%	0.0000%	1.6377%	0.0008%
2017.1.1-2017.12.31	3.3835%	0.0014%	0.3549%	0.0000%	3.0286%	0.0014%
2018.1.1-2018.12.31	3.4847%	0.0017%	0.3549%	0.0000%	3.1298%	0.0017%
2019.1.1-2019.6.30	1.2000%	0.0006%	0.1760%	0.0000%	1.0240%	0.0006%
自基金合同生效起至今	10.3498%	0.0019%	1.1696%	0.0000%	9.1802%	0.0019%

2、自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

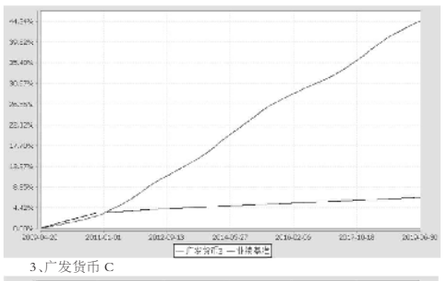
广发货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2005 年 5 月 20 日至 2019 年 6 月 30 日)

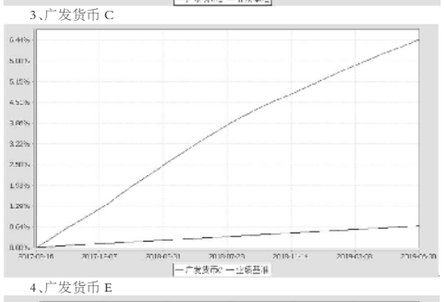
1、广发货币 A



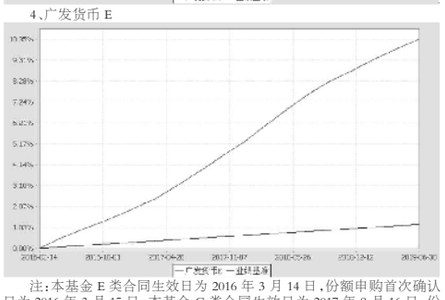
2、广发货币 B



3、广发货币 C



4、广发货币 E



注：本基金 E 类合同生效日为 2016 年 3 月 14 日，份额申购首次确认日为 2016 年 3 月 15 日；本基金 C 类合同生效日为 2017 年 8 月 16 日，份额申购首次确认日为 2017 年 8 月 17 日。

十三、基金的费用

一、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、销售服务费；
4、基金合同生效后的基金信息披露费用；
5、基金合同生效后与基金相关的会计师费与律师费；
6、基金份额持有人大会费用；
7、基金的证券交易费用；
8、银行汇划费用；
9、E 类基金份额上市费用及上市年费；
10、按照国家有关规定和本基金合同约定，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资产总值中扣除。

二、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

基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

管理费的计算方法如下：
H ＝ E ×0.33%÷当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H ＝ E ×0.10%÷当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

3、销售服务费

在通常情况下，本基金的销售服务费计算方法如下：
H＝E×G÷当年天数
H 为每日应计提的销售服务费
E 为前一日基金资产净值
G 为对应的销售服务费率

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%；本基金 B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%；本基金 E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。

销售服务费每日计算，每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给销售机构，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

上述(一)中 4 到 8 项费用由基金托管人根据其它有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。上述(一)基金费用的种类中第 9 项费用由基金托管人根据有关法律及相应协议的规定，按费用实际支出支付，由 E 类基金份额持有人承担，列入当期基金费用。

三、本基金不列入基金费用的项目

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资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前的相关费用，包括但不限于信息披露费、验资费、会计师费和律师费等不列入基金费用。

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、基金托管费率或基金销售服务费等相关费率。调整基金管理费率、基金托管费率或调高基金销售服务费等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金销售服务费等费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟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公告。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其它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，对原广发货币市场基金更新的招募说明书的内容进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在"重要提示"部分，更新了本招募说明书(更新)所载内容截止日。
2、在"八、基金份额的申购、赎回与转换"部分，更新了部分内容。

广发基金管理有限公司
二〇二〇年三月十九日

（上接 C84 版）

70、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 40 层 4601 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：李海燕
电话：010-65309516
传真：010-65330699
客服电话：400-673-7010
网址：www.jianfortune.com
71、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：北京市朝阳门外大街 18 号丰联广场 A 座 1009
联系人：胡明哲
电话：15810201340
传真：028-62825388
客服电话：400-8557333
网址：www.jhjhome.com
72、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：022-23297867
客户服务电话：400-706-6880
网址：www.fhcfjj.com
73、泰诚财富基金销售(大连)有限公司
住所：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号
联系人：徐江
电话：18840800358
客服电话：400-0411-001
网址：www.haojiyoujijin.com
74、北京蛋卷基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
法定代表人：钟斐斐
联系人：衡欢
电话：18576351064
客服电话：400-159-9288
网址：danjuanapp.com
75、中民财富基金销售(上海)有限公司
住所：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元
办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 27 层
法定代表人：弭洪军
联系人：黄鹏
电话：18521506916
客服电话：400-876-5716
网址：www.cmiwm.com

(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：010－66578680
网址：www.orient-fund.com 或 www.df5888.com

(四)出具法律意见书的律师事务所

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)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：东方创新科技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、基金投资目标和投资范围

(一)投资目标

在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。

(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，包括国内依法发行上市的股票(包括创业板股票、中小板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证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)。

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：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%；投资于具有科技创新的行业及上市公司的股票占非现金基金资产的比例不低于 80%；现金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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

七、基金的投资策略

本基金结合自上而下和自下而上的分析，在大类资产配置基础上精选个股，严格控制投资风险，追求基金的长期、稳定增值。

(一)类别资产配置

在类别资产的配置上，本基金结合宏观经济因素、市场估值因素、政策因素、市场情绪因素等分析各类资产的市场趋势和收益风险水平，进而对股票、债券和货币市场工具等类别的资产进行动态调整。

(二)股票投资策略

1、"创新科技"概念的界定

本基金所定义的创新科技主要是指创造和应用新知识和新技术、新工艺，采用新的生产方式和经营管理模式，开发新产品，提高产品质量，提供新服务的过程。

与"创新科技"概念相关的行业主要有：以技术为核心的行业，以及受益于信息通信等技术的发展，积极改造原有业务结构的行业(各行业子行业间可能出现交叉)。以技术为核心的行业包括但不限于节能环保、新能源、机械、电力设备轻工制造、新材料、汽车、家电、国防军工、计算机、通信、信息技术等行业。受益于信息通信等技术的发展，积极采用互联网改造原有业务结构的行业包括但不限于纺织服装、生物医药、建筑、建材、交通运输、银行、非银金融、电力、公用事业、商贸零售、餐饮旅游、纺织服装、医药、食品饮料、农林牧渔等行业。

我国正处于产业升级、战略转型的关键时期，如果未来由于技术进步或政策变化导致本基金"创新科技"概念的覆盖范围发生变动，本基金在深入研究的基础之上，有权把变动行业内的公司股票纳入本基金主题的界定范围内。

2、个股投资分析

(1)定性分析

本基金将结合财务数据、企业学习与创新能力、企业发展战略、技术专利优势、市场拓展能力、公司治理结构和管理水平、公司的行业地位、公司增长的可持续性等定性因素，给予股票一定的折溢价水平，最终确定股票合理的价格区间。

(2)定量分析

在定量分析方面，本基金将通过对成长性指标(预期主营业务收入增长率、净利润增长率、PEG)、相对价值指标(P/E、P/B、P/CF、EV/EBIT-DA)以及绝对估值指标(DCF)的定量评判，筛选出具有 GARP(合理价格成长)性质的股票。

(三)债券投资策略

1、久期调整策略

本基金将根据对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，进而主动调整所持有的债券资产组合的久期值，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值，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带来的资本损失，获得较高的再投资收益。

2、期限结构策略

在目标久期确定的基础上，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。

3、类属资产配置策略

根据资产的发行主体、风险来源、收益率水平、市场流动性等因素，本基金将市场主要细分为一般债券(含国债、央行票据、政策性金融债等)、信用债券(含公司债券、企业债券、非政策性金融债券、短期融资券、地方政府债券、资产支持证券等)、附权债券(含可转换公司债券、可分离交易公司债券、含回售及赎回选择权的债券等)三个子市场。在大类资产配置的基础上，本基金将通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求状况、信用风险状况等因素进行综合分析，在目标久期控制及期限结构配置基础上，采取积极投资策略，确定类属资产的最优配置比例。

(1)一般债券投资策略

在目标久期控制及期限结构配置基础上，对于国债、中央银行票据、政策性金融债，本基金主要通过跨市场套利等策略获取套利收益。同时，由于国债及央行票据具有良好的流动性，能够为基金的流动性提供支持。

(2)信用债券投资策略

信用评估策略：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、公司运营管理分析等调查研究，分析违约风险即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。

回购策略：回购放大是一种杠杆投资策略，通过质押组合中的持仓债券进行正回购，将融得资金购买债券，获取回购利率和债券利率的利差，从而提高组合收益水平。影响回购放大策略的关键因素有两个：其一是利差，即回购资金成本与债券收益率的关系，只有当债券收益率高于回购资金成本时，放大策略才能取得正的回报；其二是债券的资本利得，所持债券的净价在放大操作期间出现上涨，则可以获取价差收益。在收益率曲线陡峭或预期利率下行的市场情况下，在防范流动性风险的基础上，适当运用回购放大策略，可以为基金持有人争取更多的收益。

(3)附权债券投资策略

本基金在综合分析可转换公司债券的债性特征、股性特征等因素的基础上，利用 BS 公式或二叉树定价模型等量化估值工具评定其投资价值，重视对可转换债券对应股票的分析与研究，选择那些公司和行业景气趋势回升、成长性好、安全边际较高的品种进行投资。对于含回售及赎回选择权的债券，本基金将利用债券市场收益率数据，运用期权调整利差(OAS)模型分析含赎回或回售选择权的债券的投资价值，作为此类债券投资的主要依据。

(四)权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型，深入分析标的资产价格及其市场隐含波动率的变化，寻求其合理定价水平。全面考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，谨慎投资，追求较稳定的当期收益。

(五)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。

八、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：60%×沪深 300 指数收益率＋40%×中债总全价指数收益率。

本基金选择中债总全价指数收益率作为债券投资部分的业绩比较基准。中债总全价指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场(银行间市场、交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期等)，是中国目前最权威，应用也最广的指数。中债总总全价指数的构成品种