东方稳健回报债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

（2012年第2号）

基金管理人：东方基金管理有限责任公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司

日 期：二〇一三年一月

重要提示

东方稳健回报债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2008年10月15日中国证券监督管理委员会《关于核准东方稳健回报债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2008〕1188号）和《关于东方稳健回报债券型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函〔2008〕473号）的核准，进行募集。本基金基金合同于2008年12月10日正式生效。

东方基金管理有限责任公司（以下简称“本基金管理人”、“管理人”或“本公司”）保证《东方稳健回报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》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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。

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金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，并对认购（或申购）本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险和本基金所投资的各种投资工具的相关风险等。在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行负担。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

有关财务数据和净值表现截止日为2012年9月30日（财务数据未经审计），本招募说明书其他所载内容截止日为2012年12月10日。

本摘要根据本基金合同和本基金《招募说明书》编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。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《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国证券投资基金运作管理办法》（以下简称《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，应详细查阅本基金合同。

一、基金合同生效日期

2008年12月10日

二、基金管理人

（一）基金管理人概况

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
成立日期：2004年6月11日
注册资本：壹亿元人民币
经营范围：基金募集；基金销售；资产管理；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
基金管理公司法人许可证编号：A039
企业法人营业执照注册号：1100001704226
联系人：李景岩
电话：010-66295888
股权结构

股东名称	出资金额（人民币）	出资比例
东北证券股份有限公司	4600万元	46%
中辉国华实业（集团）有限公司	1800万元	18%
渤海国际信托有限公司	1800万元	18%
河北省国有资产控股运营有限公司	1800万元	18%
合 计	10000万元	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，下设总经理办公会、风险控制委员会、投资决策委员会、产品委员会和董事会办公室、综合管理部、人力资源部、监察稽核部、财务部、信息技术部、登记清算部、研究部、基金管理部、交易部、专户管理部、金融工程部、国际业务部、市场部、销售管理部十五个职能部门及上海分公司；公司设督察长、分管监察稽核部，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；现任东方基金管理有限责任公司董事长、兼任东北证券股份有限公司董事、吉林大学商学院教师、中国证券投资基金业协会理事。

杨树财先生，董事、硕士，中国注册会计师、高级会计师。历任广西北海吉兴会计师事务所主任会计师、吉林会计师事务所副所长、东北证券有限责任公司财务总监、副总裁兼财务总监、东方基金管理有限责任公司董事长；现任东北证券股份有限公司总裁、副董事长，兼任吉林省高级职称评委会委员，中国证券业协会财务会计委员会执行委员。

齐伟丽女士，董事，会计师。历任中国计算机软件与技术服务总公司工程师，中软总公司多维公司会计师，北京宏世通达商贸集团财务部长，中辉投资有限公司财务总监，新疆中建投资有限责任公司总经理，中天高科特种车辆有限公司副总经理，北京中辉阳光房地产开发有限公司董事；现任北京京发置业有限公司监事，北京宏世通达商贸集团副总经理。

彭铭巧女士，董事，经济学硕士。历任黑龙江证券有限公司深圳营业部交易员、研究员，特区时空杂志社编辑，国泰君安证券公司海口营业部研究员，海航集团有限公司证券业务部研究室经理，海航集团财务有限公司投资银行部理财主管；现任渤海国际信托有限公司投资部总经理。

邱建武先生，董事，高级工程师。历任德坊市轴瓦厂团支部书记，河北省粮油工业公司总经理、党支部书记，河北省粮油集团公司副总裁、党委常委，河北省粮食局副局长、党组成员，河北省商贸集团公司党委书记、董事长，河北省工贸资产经营有限公司党委书记、董事长、总裁；现任河北省国有资产控股运营有限公司董事长，河北省商贸有限公司董事长，河北省机械工业供销协会名誉理事长，河北省商业会计学会名誉会长。

孙峥伟先生，董事，经济学博士。历任吉林省社会科学院助理研究员，东北证券股份有限公司投资银行部经理，东方基金管理有限责任公司督察长、新华基金管理有限公司总经理助理，安信证券股份有限公司基金公司筹备组副组长，安信基金管理有限责任公司副总经理；现任东方基金管理有限责任公司总经理。

田瑞璋先生，独立董事，大学本科。历任中国北方工业（集团）总公司副总经理，中国兵器工业总公司总经济师、副总经理、党组成员（副部级），中国工商银行党委副书记、副行长、中央金融工委委员（副部级），工商东亚金融控股有限公司全国政协委员、工商东亚董事长；现任中国扶贫开发协会常务副会长（中组部任命、副部级）、中国金融学会常务理事、中国城市金融学会副会长、中国宏观经济学会常务理事、渤海银行独立董事、晋商银行独立董事。

金硕先生，独立董事，教授。历任吉林大学总务办公室副主任、副教授、教授，长春税务学院党委书记、院长，长春市政协委员，吉林省政协委员、文教卫生委员会副主任；现任吉林财经大学党委书记。

关雪凌女士，独立董事，经济学博士。历任中国人民大学东欧中亚研究所副所长、所长；现任中国人民大学俄罗斯研究中心主任、国务院发展研究中心欧亚社会发展研究所特约高级研究员、中国俄罗斯东欧中亚学会常务理事。

2.监事会成员

何俊岩先生，监事会主席，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。历任东北证券股份有限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，东北证券股份有限公司财务总监，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总裁，吉林省总会计师协会副会长，吉林省证券业协会副会长，东证融通投资管理有限公司董事。

田文艳女士，监事，本科，会计师。历任北京市丰台区石油销售有限公司会计、北京中天高科特种车辆有限公司主管会计、北京中天行房车俱乐部有限公司主管会计、蓝色港湾有限公司财务部经理；现任中辉国华实业（集团）有限公司财务总监助理。

杨晓燕女士，监事，哲学硕士，金融学研究生，高级经济师。曾任职北京银行等金融机构，18年金融、证券从业经历；现任本公司监察稽核部经理。

3.其他高级管理人员

孙峥伟先生，总经理，简历请参见董事介绍。

王兴宇先生，副总经理，美国密西法尼亚印第安那大学工商管理硕士、美国依阿华大学法律学硕士；具有7年基金从业经历和5年保险从业经历，曾任中法人寿保险有限责任公司宣传公关及法律部经理、董事会秘书，先后任职于博时基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、益民基金管理有限公司。2009年9月加盟本公司。

李景岩先生，督察长，硕士研究生，中国注册会计师。具有15年证券从业经历，曾任东北证券股份有限公司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
杨林耘（女士）	2008年12月10日至今	北京大学经济学院金融硕士。19年金融、证券从业经历，曾先后在武汉融利期货任首席交易员和高级分析师，在泰康人寿保险资产管理公司任高级项目经理，在中国对外经济贸易信托有限公司任融资业务部总经理助理、交易部总经理助理、证券业务部高级投资经理。2008年11月加盟本公司，现任东方保本混合型开放式证券投资基金基金经理。
郑军恒（先生）	2008年12月10日至2010年9月29日任本基金基金经理。	

5.投资决策委员会成员

孙峥伟先生：总经理，投资决策委员会主任委员。简历请参见董事介绍。

庞斌先生：总经理助理兼投资总监，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理，投资决策委员会副主任委员。浙江大学生命科学院理学硕士学历，12年证券从业经验，曾担任申银万国证券研究所行业分析师，富国基金行业分析师，汇添富基金管理有限公司投资决策委员会委员、基金投资部副总监、高级研究员、研究主管、基金经理。2010年5月加盟本公司。

张岗先生：西北大学经济学博士，11年证券从业经历。历任健桥证券股份公司行业公司部经理，天治基金管理公司研究员、天治财富增长混合型证券投资基金基金经理（2006年3月-2007年4月），投资副总监、投资决策委员会委员，建信基金管理公司专户投资部总监助理、副总监。2010年4月加盟本公司，现任东方核心动力股票型开放式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基金经理，研究部经理，投资决策委员会委员。

于鑫先生：东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理，东方策略成长股票型开放式证券投资基金基金经理，基金管理部经理，投资决策委员会委员。清华大学MBA，CFA；11年证券从业经历，曾任世纪证券有限公司资产管理部投资经理；2005年加盟本公司。

李骥先生：首席策略分析师，东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理，投资决策委员会委员。北京大学经济学博士，11年证券从业经历，曾任嘉实基金管理有限公司研究部副总监、长盛基金管理有限公司研究部副总监。2007年9月加盟本公司，曾任研究部经理。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系

三、基金托管人

（一）基金托管人情况

1.基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字〔1998〕12号
联系人：尹 东
联系电话：（010）6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码：939）于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股（包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股）。

截至2012年9月30日，中国建设银行资产总额132,964.82亿元，较上年末增长8.26%。截至2012年9月30日止九个月，中国建设银行实现净利润1,585.19亿元，较上年同期增长13.87%。年化平均资产回报率为1.65%，年化加权平均净资产收益率为24.18%。利息净收入2,610.24亿元，较上年同期增长17.05%。净利差为2.57%，净利息收益率为2.74%，分别较上年同期提高0.01和0.06个百分点。手续费及佣金净收入699.21亿元，较上年同期增长1.64%。

中国建设银行在中国内地设有13万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在美斯科、台北设有代表处，海外机构已覆盖到全球13个国家和地区，基本完成在全球主要金融中心的网络布局，24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行20家，拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司，为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。

2012年上半年，本集团各方面良好表现，得到市场与社会各界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的30多个重要奖项。本集团在英国《银行家》2012年“全球银行1000强”中位列第6，较去年上升2位；在美国《财富》世界500强中排名77位，较去年上升31位；在美国《福布斯》2012年度全球上市公司2000强排名第13位，较去年上升4位。本集团是境内唯一一家连续四年蝉联香港《亚洲公司治理》杂志颁发的“亚洲企业管治年度大奖”的上市公司，并先后获得《环球金融》、《财资》、中国银行业协会等颁发的“中国最佳银行”、“卓越管理及公司管治”与“2011年度最具社会责任金融机构”等奖项。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、核算处、清算处、监督稽核处，涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工209人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

2.主要人员情况

杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3.基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2012年9月30日，中国建设银行已托管267只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行在2005年及自2009年起连续三年被国际权威杂志《环球托管人》评为“中国最佳托管银行”，在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”奖，并获和讯网2011年度和2012年度中国“数据资产托管银行”奖。

（二）基金托管人的内部控制制度

1.内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，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

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

3.内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（三）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

1.监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2.监督流程

①每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

②收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

③根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

④通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

四、相关服务机构

（一）销售机构

1.直销机构：

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3层
法定代表人：崔伟
联系人：张婷
电话：010-66295921
传真：010-66578690
网址：www.orient-fund.com或www.df5888.com

2.代销机构

①中国建设银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼长安兴融中心
法定代表人：王洪章
联系人：王琳
传真：010-66275654
客户服务电话：95533
网址：www.ccb.com

②中国工商银行股份有限公司
住所：中国北京复兴门内大街55号
办公地址：中国北京复兴门内大街55号
法定代表人：娄建清
联系人：王佺
电话：010-66107900
传真：010-66108013
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

③中国银行股份有限公司
住所：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 号中国银行总行办公大楼
法定代表人：肖 钢
联系人：宋亚萍
电话：010-66596688
传真：010-66593157
客户服务电话：95566
网址：www.boc.cn

④招商银行股份有限公司
住所：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
法定代表人：秦晓
联系人：邓炯鹏
电话：0755-83077278
传真：0755-83195109
客户服务电话：95555
网址：www.cmbchina.com

⑤中国民生银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：董文标
联系人：董云巍
电话：010-58351666
传真：010-83914283
客户服务电话：95568
网址：www.cmbc.com.cn

⑥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
法定代表人：李国华
联系人：陈春林
传真：010-68858117
客户服务电话：95580
网址：www.psbc.com

⑦北京银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址：北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人：闫冰竹
联系人：谢小华
电话：010-66223587
传真：010-66226045
客户服务电话：95526
网址：www.bankofbeijing.com.cn

⑧中信银行股份有限公司
住所：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人：孔丹
联系人：宋晓明
电话：010-65541585
传真：010-65541230
客户服务电话：95558
网址：bank.ecitic.com

⑨交通银行股份有限公司
住所：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：胡怀邦
联系人：陈铭铭
电话：021-58781234
传真：021-58408440
客户服务电话：95559或拨打各城市营业网点咨询电话
网址：www.95559.com.cn

⑩中国农业银行股份有限公司
住所：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人：蒋超良
客户服务电话：95599
网址：www.abchina.com

⑪东北证券股份有限公司
住所：长春市自由大路1138号
办公地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：矫正中
联系人：潘锵
电话：0431-85096709
客户服务电话：4006000686
网址：www.nesc.cn

⑫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：田薇
电话：010-66568888
传真：010-66568990
客户服务电话：400-888-8888
网址：www.chinastock.com.cn

⑬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：北京朝阳区亮马桥路48号
法定代表人：王东明
联系人：陈忠
电话：010-60838888
传真：010-60833799
客户服务电话：各地营业部咨询电话
网址：www.ecitic.com

⑭中银万国证券股份有限公司
住所：上海市常熟路171号
办公地址：上海市常熟路171号
法定代表人：储晓明
联系人：李清怡
电话：021-54033888
传真：021-54035333
客户服务电话：95523或4008895523
网址：www.sw2000.com.cn

⑮海通证券股份有限公司
住所：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市黄浦区广东路689号
法定代表人：王开国
联系人：李笑鸣
电话：021-23219275
传真：021-23219100
客户服务电话：021-95553、400-8888-001 或拨打各城市营业网点咨询电话
网址：www.htsec.com

⑯中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
联系人：权唐
电话：010-85130588
传真：010-65182261
客户服务电话：400-8888-108
网址：www.csc108.com

⑰大同证券股份有限公司
住所：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人：侯巍
联系人：郭瑨
电话：0351-8686659
传真：0351-8686619
客户服务电话：400-666-1618
网址：www.i618.com.cn

⑱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：徐浩明
联系人：李芳芳
电话：021-22169999
传真：021-22169134
客户服务电话：10108998
网址：www.ebscn.com

⑲中信证券（浙江）有限责任公司
住所：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人：邓军
联系人：周妍
电话：0571-85112510
传真：0571-85783771
客户服务电话：0571-96598
网址：www.bigsun.com.cn

⑳国元证券股份有限公司
住所：安徽省合肥市寿春路178号
办公地址：安徽省合肥市寿春路178号
法定代表人：凤良志
联系人：祝丽萍
电话：0551-2257012
传真：0551-2272100
客户服务电话： 95578
网址：www.gyzq.com.cn

㉑中信万通证券有限责任公司
住所：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（0507-1510室）
办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层（266061）
法定代表人：张智河
联系人：吴忠超
电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
客户服务电话：0532-96577
网址：www.zxwt.com.cn

㉒东方证券股份有限公司
住所：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22层-29层
法定代表人：王益民
联系人：吴宇
电话：021-63325888
传真：021-63326173
客户服务电话：021-962506或40088-88506
网址：www.dfzq.com.cn

㉓广发证券股份有限公司
住所：广东省广州市天河北路183号大都会广场43楼
办公地址：广州市天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41、42、43、44 楼
法定代表人：孙树明
联系人：黄岚
电话：020-87555888
传真：020-87555305
客户服务电话：95575
网址：www.gf.com.cn

㉔兴业证券股份有限公司
住所：福建省福州市湖东路99号标力大厦
办公地址：上海市陆家嘴东路166号中保大厦
法定代表人：兰荣
联系人：谢高得
电话：021-68419393-1098
传真：021-68419867
客户服务电话：4008888123
网址：www.xyzq.com.cn

㉕宏信证券股份有限公司
住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35 层、28 层A02 单元
办公地址：深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层
法定代表人：牛冠兴
联系人：陈剑虹
电话：0755-82558305
传真：0755-82558355
客户服务电话：4008001001
网址：www.essence.com.cn

㉖国信证券股份有限公司
住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
联系人：齐晓燕
电话：0755-82130833
传真：0755-82133952
客户服务电话：95536
网址：www.guosen.com.cn

㉗长江证券股份有限公司
住所：武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
联系人：李良
电话：027-65799999
传真：027-85481900
客户服务电话：95579或4008-888-999
网址：www.95579.com

㉘招商证券股份有限公司
住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人：宫少林
联系人：林昭生
电话：0755-82943666
传真：0755-82943636
客户服务电话：95565、4008888111
网址：www.newone.com.cn

㉙齐鲁证券有限公司
住所：济南市经七路86号
办公地址：济南市经七路86号23层
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
电话：0531-68889155
传真：0531-68889752
客户服务电话：95538
网址：www.qlzq.com.cn

㉚国泰君安证券有限公司
住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
联系人：张宇宏
电话：0451-82336863
传真：0451-82287211
客户服务电话：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn

㉛宏源证券股份有限公司
住所：新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯戎
联系人：李巍
电话：010-88085858
传真：010-88085195
客户服务电话：4008-000-562
网址：www.hysec.com

㉜华福证券有限责任公司
住所：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8、10层
法定代表人：黄金琳
联系人：张腾
电话：0591-87383623
传真：0591-87383610
客户服务电话：96326（福建省外请先拨0591）
网址：www.gfhfzq.com.cn

㉝五矿证券有限公司
住所：深圳市福田区金田路4028号经贸中心48楼
办公地址：深圳市福田区金田路4028号经贸中心48楼
法定代表人：张永衡
联系人：高克南
电话：0755-82545707
传真：0755-87383610
客户服务电话：40018-40028
网址：www.wkzq.com.cn

㉞恒泰长财证券有限公司
住所：长春市长江路经济开发区人民大街280号科技城2层A-33段
办公地址：长春市长江路经济开发区人民大街280号科技城2层A-33段
法定代表人：赵培武
联系人：曲志诚
电话：0431-82945299
传真：0431-82946531
客户服务电话：0431-82951765
网址：www.cczq.net

㉟东莞证券有限责任公司
住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心30楼
办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人：张运勇
联系人：苏荫仁
电话：0769-22112062
客户服务电话：961130（省内直拨，省外请加拨区号0769）
网址：www.dgzq.com.cn

㊱华安证券有限责任公司
住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座
法定代表人：李工
联系人：钱欢
电话：0551-5161666
传真：0551-5161600
网址：www.hazq.com

㊲方正证券股份有限公司
住所：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
联系人：郭军瑞
电话：0731-85832503
传真：0731-85832214
客户服务电话：95571
网址：www.foundersc.com

㊳上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟
联系人：吕慧
电话：021-58788678-8816
传真：021-58788678-8101
客户服务电话：400-089-1289
网址：www.erichfund.com

㊴杭州数米基金销售有限公司
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
联系人：周嫣旻
电话：0571-28829790
传真：0571-26698533
客户服务电话：400-076-6123
网址：www.fund123.cn

㊵深圳众禄基金销售有限公司
住所：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1、J单元
办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1、J单元
法定代表人：薛峰
联系人：汤素娅
电话：0755-33227950
传真：0755-82080798
客服电话：400-678-8887
网址：www.zlfund.cn及www.jimmw.com

㊶上海好买基金销售有限公司
住所：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
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
联系人：汪荣
电话：021-58870011
传真：021-68596916
客户服务电话：400-700-9665
网址：www.ehowbuy.com

㊷上海天天基金销售有限公司
住所：浦东新区峨山路613号6幢551室
办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法定代表人：其实
联系人：陈琪
电话：021-54509998-2010
传真：021-64385308
客户服务电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn

（二）注册登记机构

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：王广辉
电话：010-66295872
传真：010-66578680
网址：www.orient-fund.com或www.df5888.com

（三）律师事务所和经办律师

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：吕红
电话：021-31358666
传真：021-31358600
经办律师：吕红 黎明

（四）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号新黄浦金融大厦4层
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、魏星

五、基金名称和基金类型

（一）本基金名称：东方稳健回报债券型证券投资基金

（二）本基金类型：债券型

基金运作方式：契约型开放式

六、基金投资目标和投资方向

（一）投资目标

在控制风险和确保资产流动性的前提下，追求较高总回报率，力争实现基金资产长期稳定增值。

（二）投资范围

本基金为债券型基金，主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、短期融资券、可转换公司债券（含可分离交易债券）、资产支持证券、债券回购等，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。

本基金还可投资于一级市场新股网上申购，公开增发新股、可转换债券转股、股票或可分离交易债券派发的权证，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类金融工具。为降低权益类头寸波动对基金收益的影响，因上述原因持有的股票，本基金将在其上市后的60个交易日内卖出，被动持有的权证在其上市后10个交易日内卖出。本基金不直接从二级市场买入股票和权证。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他创新的证券品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：固定收益类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的80%，其中，信用类固定收益品种（国债、央行票据、政策性金融债及法律法规或中国证监会认定的其他准政府信用债券除外）的比例不超过基金资产的50%，可转换债券的比例不超过基金资产的30%，股票等权益类资产的比例不超过基金资产的20%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

七、基金的投资策略

本基金奉行“积极投资、稳健增值”的投资理念，在保持组合较低波动性的同时，采用稳健的资产配置策略和多种积极管理增值手段，实现较高的总回报率。

1.固定收益类资产投资策略

①利率预期策略

利率预期策略是债券型基金采用的最基本的策略，主要通过对组合久期的控制实现对利率风险的有效管理。本基金以“目标久期”管理作为利率预期策略的核心内容，通过深入研究宏观经济运行态势和宏观政策导向，判断市场利率变动的趋势和幅度，运用敏感性分析，模拟利率变动的多种可能性，测算业绩比较基准与投资组合在利率变动情况下，由久期脆弱的损益状况，并根据投资组合的风险承受能力确定组合的目标久期区间。

具体来说，“目标久期”的确定包括以下三个方面：

第一，宏观经济分析。基准利率的变动是由一国的宏观经济发展状况所决定的，因此，宏观经济的研判是债券投资的首要任务。本基金对反映宏观经济变化的各种变量，如消费、投资、进出口、资金流向等因素进行持续的跟踪与分析，考察宏观经济的运行趋势及在经济周期中所处的地位，合理预期宏观经济政策（包括财政与货币政策）的最新取向。

第二，市场利率变动趋势分析。市场利率的变动主要体现为对未来政策（尤其是货币政策）的预期，而宏观政策的变动取决于宏观经济的发展态势。本基金除密切关注宏观经济数据，还将目前的经济数据表现与历史的经济周期进行比较，判断当前的宏观环境对市场利率的影响方向和幅度，以及投资人的一致预期如何影响市场利率变动的时间和方式。

第三，目标久期分析。根据对市场利率变动趋势、利率所处经济周期的分析，并结合当前市场的利率水平，确定组合目标久期变动的方向。一般来说，在利率上行通道中，应缩短目标久期以规避利率风险；在利率下行通道中，应拉长目标久期以享受债券价格上涨带来的收益。本基金在预测目标久期变动方向之后，运用敏感性分析，模拟利率变化幅度的多种可能性，考察比较基准与投资组合在利率变动时的风险收益特征，确定组合的目标久期区间，有效控制风险，获取投资收益。

②收益率曲线策略

收益率曲线的变动可以分为平行移动和非平行移动两种。平行移动指各期限的收益率对于利率变动做出相同幅度的变化，包括向上平行移动和向下平行移动；而非平行移动则指各期限收益率对于利率变动产生不同的调整幅度，收益率曲线的斜率、形状都会发生变化。实际上