

(上接C72版) 法定代表人:钟斐斐 电话:010-84997571 客服电话:400-159-9288 公司网址:www.danjuanpp.com 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。

(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:陈颖华 经办律师:黎明、陈颖华

(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号展业大厦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:陈熹、叶尔甸 电话:021-23238888 传真:021-23238800 联系人:乐美吴

四、基金名称 东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金。 五、基金类型 混合型证券投资基金。 六、基金的投资目标 本基金在严格控制投资风险的前提下,追求资产净值的长期稳健增值。

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,包括国内依法发行的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市)的股票、港股通标的股票、固定收益类金融工具、权证、股指期货、国债期货以及经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)。

八、基金的投资策略 本基金投资的具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国内依法发行的国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、次级债、中央银行票据、企业债、公司债、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、债券回购、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债、证券公司发行的短期公司债券、资产支持证券、银行存单(包括协议存款、通知存款、定期存款)、同业存单、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他固定收益类证券品种(但须符合中国证监会的相关规定)。

九、基金的投资比例 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。 本基金的投资比例为: 本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0%-30%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%); 开放期每个交易日日终,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%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,封闭期内每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

十、基金的投资限制 如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。 八、基金的投资策略 本基金通过严谨的大类资产配置策略和个券精选策略,在做好风险管理的基础上,运用多样化的投资策略实现基金资产的稳定增值。

1.资产配置 本基金通过定性研究与定量研究相结合的方法,确定投资组合中股票、债券和现金类资产的配置比例。 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,并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,最终确定大类资产配置权重,实现资产配置。

2.固定收益类投资策略 (1)普通债券投资策略 1)久期控制:根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期,有效的控制整体资产风险。 2)期限结构配置:在确定组合久期后,基金管理人将针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构,通过采用子弹策略、杠铃策略、梯子策略等,在长期、中期与短期债券间进行动态调整,从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。 3)市场比较:不同债券子市场的运行规律不同,本基金在充分研究不同债券子市场风险-收益特征、流动性特性的基础上构建调整组合(包括跨市场套利操作),以提高投资收益。 4)相对价值判断:本基金将在相近的债券品种之间选取价值相对低估的债券品种进行投资。 5)信用风险评估:本基金将根据发债主体的经营状况与现金流等情况对其信用风险进行评估与估值,以此作为品种选择的基本依据。

(2)可转换公司债券、可分离交易可转换债券和可交换债的投资策略 本基金参与可转换公司债券、可分离交易可转换债券和可交换债有两种途径,一种是一级市场申购,另一种是二级市场参与。一级市场申购,主要考虑发行条款较好、申购收益较高、公司基本面优秀的个券;二级市场参与可运用多种投资策略,本基金将运用企业基本面分析和理论价值分析策略,精选个券,力争获取较高的投资收益。同时,本基金也可以采用相对价值分析策略,即通过分析不同市场环境下可转换公司债券、可分离交易可转换债券和可交换债的相对价值,把握可转换公司债券、可分离交易可转换债券和可交换债的价值走向,选择相应品种,从而获取较高投资收益。另外,本基金将密切关注可转换公司债券、可分离交易可转换债券和可交换债的套利机会和条款博弈机会。

(3)中小企业私募债券投资策略 由于中小企业私募债券具有流动性较差、信用风险较高、资产规模较小等特点,本基金主要采取审慎投资的态度,深入分析发债主体的经营情况、偿债能力等,从而评估信用风险的程度,严格控制信用风险和流动性风险,选择发行主体资质状况优良、估值合理且流通较好的品种进行投资。

(4)资产支持证券投资 本基金资产支持证券的投资将采用自下而上的方法,结合信用管理和流动性管理,重点考察资产支持证券的资产池现金流变化、信用风险情况、市场流动性等,采用量化方法对资产支持证券的价值进行定价,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,在有效分散风险的前提下为投资人谋求较高的资产组合回报率。

(5)债券回购杠杆策略 本基金将在市场资金面和债券市场基本面分析的基础上结合个券分析和组合风险管理结果,积极参与债券回购交易,放大固定收益类资产投资比例,追求固定收益类资产的超额收益。

(6)证券公司短期公司债券投资策略 本基金证券公司短期公司债券的投资策略主要从分析证券行业整体情况、证券公司基本面情况入手,包括整个证券行业的发展现状、发展趋势,具体证券公司的经营情况、资产负债情况、现金流情况,从而分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利率水平,对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。

3.权益类投资策略 (1)行业配置策略 本基金将主要遵循“自下而上”的投资理念,结合当前宏观经济运行情况及发展趋势、国家政策等因素,考察行业运行周期、发展空间等,重点关注具有良好发展前景的行业。

(2)个股选择策略 本基金结合定性分析和定量分析的方法选择估值合理、具有持续竞争优势和较大成长空间的个股进行投资。 定性分析主要基于投研团队对公司的案头研究和实地调研,包括所属细分行业情况、市场供求、商业模式、核心技术等内容,深入分析公司的治理结构、经营管理、竞争优势,综合考虑公司的估值水平和未来盈利空间。

定量分析主要根据相关财务指标,如营业利润率、净利率、每股收益(EPS)增长、主营业务收入增长等,分析公司经营情况、财务情况等,并结合利用市盈率法(P/E)、市净率法(P/B)、折现现金流法(DCF)对公司进行合理估值。

(3)港股投资策略 本基金将通过内地与香港股票市场互联互通机制投资于香港股票市场,不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。 本基金将重点关注: 1)A股稀缺性行业个股; 2)具有持续领先优势或核心竞争力的企业,这类企业应具有良好成长

性或为市场龙头; 3)符合内地政策和投资逻辑的主题性行业个股; 4)与A股同行业公司相比具有估值优势的公司。 4.股指期货投资策略 本基金股指期货投资将根据风险管理的原则,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。

5.国债期货投资策略 本基金对国债期货的投资将根据风险管理的原则,以套期保值、回避市场风险为主要目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作,获取超额收益。

6.权证投资策略 本基金在权证投资中以对标的证券的基本面为基础,结合权证定价模型、隐含波动率、交易制度设计等多种因素对权证进行合理估值,谨慎投资,在风险可控的前提下实现较稳定的当期收益。本基金权证投资的原则为有利于基金资产增值、加强基金风险控制。

九、基金的业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%+中债综合指数收益率×80%。 沪深300指数是由上海证券交易所和深圳交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数,它的样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票,能够反映A股市场总体发展趋势。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制,以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本,以其发行量为权数的加权平均股价指数,是反映香港股市价格趋势最有影响的一种股价指数。

中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场,成份债券包括国债、企业债券、央行票据等所有主要债券种类,具有广泛的市场代表性,能够反应中国债券市场的总体走势。

若未来上述指数编制机构决定停止发布指数、市场发生变化导致该业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准,基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略,调整本基金的业绩比较基准。业绩基准的变更须经基金管理人及基金托管人协商一致,在履行适当程序后报中国证监会备案,并在中国证监会指定的媒介上及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

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和货币市场基金,低于股票型基金。 本基金除了投资A股外,还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

十一、基金的投资组合报告 以下投资组合报告数据截至2019年12月31日。 1.报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include 权益投资, 基金投资, 固定收益投资, 资产支持证券, 贵金属投资, 金融衍生品投资, 买入返售金融资产, 其他资产, 合计.

注:本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为74,612,776.25元人民币,占期末基金资产净值比例2.77%。

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

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include A 农林牧渔, B 采矿业, C 制造业, D 电力、热力、燃气及水生产和供应业, E 建筑业, F 批发和零售业, G 交通运输、仓储和邮政业, H 住宿和餐饮业, I 信息技术、软件和信息技术服务业, J 金融业, K 房地产业, L 租赁和商务服务业, M 科学研究和技术服务业, N 水利、环境和公共设施管理业, 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)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

Table with 3 columns: 行业类别, 公允价值(人民币), 占基金资产净值比例(%). Rows include A 基础材料, B 消费者必需品, C 消费者常用品, D 能源, E 金融, F 医疗保健, G 工业, H 信息技术, I 电信服务, J 公用事业, K 房地产, 合计.

注:以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, GICS)。 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

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1 01088 中国神华, 2 600030 中信证券, 3 601668 中国建筑, 4 002065 东华软件, 5 02238 广汽集团, 6 01055 中国南方航空股份, 7 002415 海康威视, 8 600585 海螺水泥, 9 000333 美的集团, 10 601939 建设银行.

4、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组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 国家债券, 2 央行票据, 3 金融债券, 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), 8 同业存单, 9 其他, 10 合计.

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组合

Table with 5 columns: 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(%). Rows include 1 143337 17国君G3, 2 018007 国开1801, 3 143294 17银河G2, 4 143825 18长电02, 5 11190492 19中国银行CD092.

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

Table with 4 columns: 序号, 证券代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 138032 19建信6A, 2 165015 金发01A.

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

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

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 本基金本报告期末未进行股指期货投资。

(2)本基金股指期货投资的投资政策 本基金股指期货投资将根据风险管理的原则,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 本基金对国债期货的投资将根据风险管理的原则,以套期保值、回避市场风险为主要目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作,获取超额收益。

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 本基金本报告期末未进行国债期货投资。

(3)本期国债期货投资评价 本基金本报告期末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19中债银行CD122(代码:111908122YH)发行主体

中信银行股份有限公司因未按规定提供报表且逾期未改正,未向监管部门报告重要信息系统运营中断事件等13项违规事项,于2019年7月3日被银保监会处以没收违法所得33.6677万元,罚款2190万元;中信银行股份有限公司杭州分行于2019年9月26日,因个人消费贷款管理不审慎,贷款资金被挪用于购房等5项违规事项被银保监会浙江监管局处以罚款195万元。@ 本基金持有的19兴业银行CD403(证券代码:111910403YH)、19兴业银行CD422(证券代码:111910422YH)发行主体兴业银行因未遵守总授信额度管理制度及对部分信用卡申请人资信水平调查严重不尽职,于2019年7月8日被中国银保监会上海监管局责令改正并处罚40万元;兴业银行北京分行于2019年9月3日因未按照规定履行客户身份识别义务,与身份不明的客户进行交易或为客户开立匿名账户、假名账户被人民银行北京营业管理部罚款145万元,因未按照规定向中国工商银行报送账户开立资料被人民银行北京营业管理部罚款5000元。@ 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跟踪研究。

本基金持有的前十名证券中其余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)其他投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3)本基金资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元). Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 待摊费用, 8 其他, 9 合计.

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Rows include 1 132015 18中油EB, 2 132013 17宝武EB, 3 132009 17中油EB, 4 113011 光大转债, 5 113020 桐昆转债, 6 110047 山鹰转债, 7 132014 18中化EB, 8 128034 江银转债, 9 113517 曙光转债, 10 110051 中天转债, 11 110052 贵广转债, 12 128019 久立转2, 13 128059 视源转债, 14 113509 新泉转债, 15 113508 新凤转债.

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

(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 基金管理人依据恪尽职守、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2019年12月31日。 1、东方红核心优选一年定期开放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

Table with 6 columns: 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. Rows include 2019年1月1日至2019年12月31日, 2018年10月9日至2019年12月31日.

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

东方红核心优选一年定期开放混合型证券投资基金与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:(1)截止日期为2019年12月31日。 (2)本基金建仓期6个月,即从2018年10月9日起至2019年4月8日,至本报告期末,本基金尚处于建仓期。

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事务所、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)投资港股通标的股票的相关费用; (10)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。

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0.7%的年费率计提。管理费的计算方法如下: H=E×0.7%÷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0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下: H=E×0.2%÷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—10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。

(二)与基金销售有关的费用 1、申购费用 本基金申购费率按申购金额递减,投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。 本基金对通过基金管理人直销中心申购本基金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本基金基金份额的养老金客户的申购费率如下:

Table with 2 columns: 申购金额(M), 费率. Rows include M<=1000元 (0.30%), M>=1000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:

Table with 2 columns: 申购金额(M), 费率. Rows include M<=1000元 (1.0%), M>=1000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、销售和登记等各项费用。 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 本基金在赎回时收取基金赎回费用,赎回费率随赎回基金份额持续持有时间的增加而递减。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。 根据份额持续持有时间分档收取,具体如下表:

Table with 2 columns: 份额持续持有时间(L), 适用赎回费率. Rows include L<=7日 (1.5%), 7日<=L<=30日 (0.75%), 30日<=L<=180日 (0.5%), L>=180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大于等于30日但小于3个月的,赎回费用总额的75%归基金财产,对份额持续持有时间大于等于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大于等于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。(注:1个月=30日)

3、基金管理人可以根据《基金合同》约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定,在指定媒介上公告。

4、当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可采用摆动定价机制,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。

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申购费率和赎回费率。

(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 基金管理人可根据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、基金销售费率,须召开基金份额持有人大会审议。基金管理人调整管理费率、托管费率,需于调整实施前书面告知基金托管人。 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项纳税主体,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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》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。 2、“三、基金管理人”部分对基金管理人概况、主要人员情况的内容进行了更新。 3、“四、基金托管人”部分对基金托管人概况、主要人员情况、基金托管业务经营情况的内容进行了更新。 4、“五、相关服务机构”部分对基金销售机构进行了更新。 5、“八、基金份额的申购、赎回与转换”部分对申购和赎回的数额限定进行了更新。 6、“九、基金的投资”部分更新了本基金投资组合报告,内容截至至2019年12月31日。 7、更新了“十、基金的业绩”,内容截至至2019年12月31日。 8、更新了“二十三、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 二〇二〇年二月二十八日