

**东兴蓝海财富灵活配置混合型  
证券投资基金  
招募说明书（更新）摘要  
（2020 年第 3 号）**

**基金管理人：东兴证券股份有限公司**

**基金托管人：中国农业银行股份有限公司**

**二零二零年七月**

## 重要提示

东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2015 年 11 月 19 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2015】2667 号文注册募集。本基金基金合同于 2015 年 12 月 23 日正式生效。

基金管理人保证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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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。

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，本基金在投资运作过程中可能面临各种风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等。

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。

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（含中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、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），投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险。

投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。

基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金

资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容更新截止日为 2020 年 6 月 23 日，基金管理人股权结构截止日为 2020 年 3 月 31 日，有关财务数据截止日为 2020 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 一、基金合同生效日期

2015 年 12 月 23 日

## 二、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：东兴证券股份有限公司

成立日期：2008 年 5 月 28 日

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）12、15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）6、10、12、15、16 层

法定代表人：魏庆华

组织形式：股份有限公司

联系人：陈智勇

联系电话：010-57307309

传真：010-57307388

注册资本：275796.0657 万元人民币

股权结构：（截止 2020 年 3 月末）

序号	股东名称	持股数量（股）	持股比例（%）
1	中国东方资产管理股份有限公司	1,454,600,484	52.74
2	山东高速股份有限公司	119,989,367	4.35
3	中国证券金融股份有限公司	82,463,160	2.99
4	福建天宝矿业集团股份有限公司	57,478,000	2.08
5	上海工业投资（集团）有限公司	48,100,000	1.74

### （二）主要人员情况

#### 1、董事会成员

魏庆华先生，1964 年 10 月出生，博士研究生学历，高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于福建清流县外贸局。曾任清流县人民银行股长、副行长；三明市人民银行办公室副主任（主持工作）；闽发证券三明分公司总经理、闽发证券副总裁、总裁，东兴证券副总经理、总经理、财务负责人，东兴期货董

事长，东兴资本董事长，东兴投资董事长。现任东兴证券董事长。

张涛先生，1972 年 8 月出生，博士研究生学历，正高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任华泰证券总裁办公室总裁秘书、投资银行一部业务经理、福州办事处副主任、上海总部投资银行业务部副总经理（主持）、深圳总部副总经理（主持）兼深圳彩田路营业部总经理、董事会秘书兼总裁助理、董事会办公室主任、副总裁，华泰期货有限公司董事长，钟山有限公司董事、副总裁，钟山金融控股有限公司董事长。现任东兴证券董事、总经理、财务负责人，东兴证券投资有限公司董事长。

谭世豪先生，1964 年 1 月出生，硕士研究生，高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国银行国际业务部科员、主任科员、副处长、处长；中国东方资产管理股份有限公司（以下简称“中国东方”）股权及投行部经理、助理总经理，资产经营部助理总经理、副总经理；深圳外贸集团董事长，监事长；邦信资产管理有限公司副总经理兼深圳分公司副总经理；中国东方人力资源部副总经理；东兴证券副董事长。现任东兴证券董事、副总经理，东兴证券（香港）金融控股有限公司董事会主席。

张军先生，1975 年 5 月出生，硕士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任北京市园林局香山公园科员；中诚信托投资有限责任公司信托经理；证监会发行监管部审核一处科员、副调研员、副处长；东兴证券首席风险官。现任东兴证券董事、副总经理，东兴香港董事。

江月明先生，1971 年 8 月出生，硕士研究生学历，持有中国律师执业资格证书，中国国籍，无境外永久居留权。2001 年 7 月至 2016 年 8 月历任中国东方经营处置审查办公室职员、高级主任，总裁办公室经理、高级经理、助理总经理，风险管理部助理总经理、副总经理，董事会办公室（引战上市办公室）副总经理（主持工作）。现任中国东方董事会办公室（上市办公室）总经理，东富（天津）股权投资基金管理有限公司董事，东方邦信创业投资有限公司董事。2017 年 3 月至今任东兴证券董事。

曾涛先生，1972 年 12 月出生。大学本科学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于中国银行股份有限公司海南省分行，中国东方海口办事处。曾任中国东方人力资源部高级经理、总经理助理、副总经理，机构管理部副总经理主持

工作，中华联合保险集团股份有限公司副总经理、合规负责人、纪委书记。现任中国东方办公室（党委办公室）总经理，大连银行股份有限公司董事。2019 年 3 月起任东兴证券董事。

董裕平先生，1969 年 10 月出生，博士研究生学历，研究员（中国社科院）、博士生导师、博士后合作导师，哈佛大学经济系访问学者，中国国籍，无境外永久居留权。曾任国家开发银行政策研究室科级行员、经济师，稽核评价局稽核一处副处长、综合处副处长、正处级行员、高级经济师；中国社会科学院金融研究所副研究员、研究员、公司金融研究室主任、法与金融研究室主任、所纪委委员、所长助理，兼任中国社会科学院投融资研究中心主任；中国东方战略发展规划部副总经理、战略发展规划部（研究院）副总经理（主持工作）。现任中国东方战略发展规划部（研究院）总经理，东方邦信融通控股股份有限公司董事。2019 年 3 月起任东兴证券董事。

周亮先生，1971 年 6 月出生，大学本科学历，高级会计师，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职济青高速公路管理局、山东高速光控产业基金管理有限公司、山东高速股份有限公司。历任山东高速股份有限公司淄博管理处计划财务科长、计划财务部副经理、审计部经理，山东高速光控产业基金管理有限公司财务总监，山东高速股份有限公司副总会计师、计划财务部经理。现任山东高速股份有限公司总会计师。2019 年 10 月任东兴证券董事。

郑振龙先生，1966 年 3 月出生，博士研究生学历，厦门大学管理学院教授，中国国籍，无境外永久居留权。曾任厦门大学研究生院副院长、经济学院副院长、金融系副主任（主持工作），华福证券股份有限公司独立董事。现任厦门大学闽江学者特聘教授，兼任华安证券股份有限公司独立董事，厦门国际银行股份有限公司独立董事、福建华通银行股份有限公司独立董事、营口港务股份有限公司独立董事和漳州片仔癀药业股份有限公司独立董事。2017 年 3 月至今任东兴证券独立董事。

张伟先生，1977 年 4 月出生，博士研究生，具有 FRM（金融风险管理师）资格，中国国籍，无境外永久居留权。2001 年 8 月至 2012 年 2 月，历任中国人民银行研究生部教研部研究实习员、副主任兼助理研究员；中国人民银行研究生部行政部副主任兼副研究员。2012 年 3 月至今任清华大学五道口金融学院校友办

主任兼副研究员。主要从事宏观经济、货币政策、汇率体制、股票投资、外汇投资、金融稳定机制、金融危机预警机制等方面研究。2017 年 3 月起任东兴证券独立董事。

宫肃康先生，1965 年 3 月出生，硕士研究生学历，注册会计师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中央财政金融学院税务系教师，北京市新技术产业开发试验区财政审计所专管员，宁波创源文化发展股份有限公司独立董事。现任北京天平会计师事务所有限责任公司执行董事、总经理，北京天平健税务师事务所执行董事、总经理。2017 年 12 月至今任东兴证券独立董事。

孙广亮先生，1963 年 7 月出生，硕士研究生学历，律师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国法律事务中心律师，众鑫律师事务所律师，大商股份有限公司独立董事。现任北京市华堂律师事务所合伙人律师、主任，大恒新纪元科技股份有限公司独立董事。2017 年 12 月至今任东兴证券独立董事。

## 2、监事会成员

秦斌先生，1968 年 4 月出生，博士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国银行总行海外行管理部科员、主任科员；中国东方股权部业务三部助理经理、股权及投行业务部副经理、市场开发部业务发展部副经理、总裁办公室综合信息处副经理（主持工作）、总裁办公室助理总经理、党委办公室和总裁办公室副主任、副总经理、党委办公室和研发中心副主任、副总经理（主持工作）、研发中心总经理、战略发展规划部总经理；东兴证券董事。现任东兴证券监事会主席。

张威先生，1977 年 9 月出生，博士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任国务院法制办公室副主任科员、主任科员、副处长、调研员兼副处长（主持工作）。现任中国诚通控股集团有限公司金融管理部总经理、诚通基金管理有限公司董事、南航国际融资租赁有限公司副董事长、诚通商业保理有限公司董事长、中企大象金融信息服务有限公司监事长。2020 年 6 月至今任东兴证券监事。

叶淑玉女士，1957 年 5 月出生，物理学学士、中欧 EMBA，高级工程师、会计师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任福州无线电七厂质检科副科长兼厂团总支书记；福州电子工业局团委委员；福州智达电脑品管部副经理；福建新世纪

电脑集团有限公司副总裁；实达电脑集团人力资源处处长、监事；实达电脑与美国 Compaq 合资公司副总经理；上海外高桥房地产有限公司副总经理。现任福建东煌投资集团股份有限公司董事、董事长助理兼董事会秘书，福建天宝矿业集团股份有限公司董事、副总裁兼董事会秘书。2017 年 3 月至今任东兴证券监事。

郝洁女士，1971 年 4 月出生，硕士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾在中国信达信托投资公司证券部财务处、信达资产管理公司资金财务部会计制度处工作，历任宏源证券机构管理总部二级部经理、资金财务部总经理助理、财务会计部副总经理；现任东兴证券财务部总经理，兼任东兴投资董事、东兴期货董事、东兴香港董事。2017 年 3 月至今任东兴证券监事会职工代表监事。

杜彬先生，1973 年 2 月出生，大学本科学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国人民银行条法司综合处科员；中国民族国际信托投资公司计划资金部职员、总裁秘书，国际业务部副经理、资产管理部总经理、综合管理部总经理，民族证券风险监控部法务负责人、合规部经理，合规部副总经理（主持）、总经理，合规部兼风险管理部总经理，合规风控部总经理；现任东兴证券合规法律部总经理、东兴投资董事、东兴期货监事、东兴资本监事、上海东策盛资产管理有限公司监事。2014 年 8 月至今任东兴证券监事会职工代表监事。

### 3、总经理及其他高级管理人员

魏庆华、张涛先生、谭世豪和张军先生，简历请参见上述关于董事的介绍

许学礼先生，1963 年 12 月出生，博士研究生学历，高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任财政部财政科学研究所助理研究员；中国南山开发公司上市小组成员；深圳证券交易所高级研究员；广州尊荣集团副总经理；深圳汉君雄投资公司副总经理；亚洲控股有限公司总裁助理；大通证券股份有限公司副总经理；东兴证券首席风险官，东兴资本董事。现任东兴证券副总经理、合规总监，东兴香港董事、东兴基金管理有限公司董事。

银国宏先生，1974 年 3 月出生，博士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国教育科技信托投资公司证券营业部研究咨询部经理；中信建投证券研究所所长助理；东兴证券研究所总经理，公司助理总经理兼研究所总经理、机构业务部总经理、资产管理业务总部总经理、基金业务部总经理。现任东兴证券副总经理、金融创新部总经理，东兴期货董事长，上海伴兴实业发展有限公司



董事长，东兴基金董事长。

刘亮先生，1974 年 10 月出生，大学本科学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于福建省政府办公厅证券办、中国证监会福建特派员办事处。曾任福建省证券监督管理委员会科员，中国证监会福建监管局科员、副主任科员、主任科员、党办副主任、稽查处副处长、纪委委员、党办副主任（主持）、党办主任；东兴证券助理总经理、总经理办公室总经理、场外市场业务总部总经理、新疆分公司总经理、深圳分公司总经理、东兴证券董事会秘书，董事会办公室总经理、福建分公司总经理。现任东兴证券副总经理、首席信息官，兼任天翼电子商务有限公司董事。

陈海先生，1970 年 12 月出生，大学本科学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任闽发证券深圳营业部会计主管、福州五一中路营业部分析师、信息研究中心股评部经理、福州北环东路营业部助理总经理；东兴证券福州北环东路营业部助理总经理、副总经理、营销总监，福州五一中路营业部江厝服务部负责人、福州江厝营业部总经理、福建分公司副总经理，公司助理总经理兼任资产管理业务总部业务一部总经理、公司助理总经理兼任资产管理业务总部总经理。现任东兴证券副总经理，东兴香港董事，东兴证券（香港）有限公司董事会主席。

张锋先生，1973 年 12 月出生，硕士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国银行总行营业部出口处职员；中国东方股权部、实业部、评估部助理经理、副经理；东兴证券北京北四环中路证券营业部总经理、企业融资部总经理、财富管理部总经理、协同发展部总经理。现任东兴证券董事会秘书、公司助理总经理。

赵慧文女士，1977 年 1 月出生，硕士研究生学历、注册会计师、资产评估师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国证监会稽查一局主任科员、中国证监会稽查局综合处副处长和处长、中国证监会发行监管部审核五处处长、中国证监会证券基金机构监管部监管六处处长、中原证券股份有限公司副总裁。现任东兴证券首席风险官。

#### 4、合规总监

许学礼先生，简历请参见上述关于总经理及其他高级管理人员的介绍。

## 5、本基金基金经理

李晨辉先生，中国科学院工学硕士，武汉大学学士，具有 9 年证券从业经验。2011 年进入东兴证券研究所从事行业研究，历任行业研究员、高级行业研究员。2014 年 2 月加入东兴证券基金部筹备组，主要负责跟踪计算机、软件等行业投资机会。现任东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴核心成长混合型证券投资基金基金经理、东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

## 6、基金业务投资决策委员会成员

银国宏先生，简历请参见上述关于经营管理层人员的介绍

王青女士，现任基金业务部总经理。

张旭先生，现任基金业务部助理总经理、投资总监。

孙继青先生，现任基金业务部基金经理。

张琳娜女士，现任基金业务部基金经理。

7、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：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计,并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISAIE3402)认证,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号;2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号;2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号;2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖;2019 年荣获证券时报授予的“2019 年度资产托管银行天玑奖”称号。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立,目前内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、

市场营销部、内控监管部、账户管理部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 310 名，其中具有高级职称的专家 60 名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止到 2020 年 3 月 31 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 523 只。

### （二）基金托管人的内部风险控制制度说明

#### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，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

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

#### 3、内部控制制度及措施

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；业务管理实行严格的复核、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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理

人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

#### 四、相关服务机构

##### （一）基金份额发售机构

##### 1、直销机构

###### （1）东兴证券股份有限公司直销中心

###### a、东兴证券股份有限公司直销柜台

办公地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 6 层

联系人：陈智勇

直销中心电话：010-57307309

传真：010-57307388

公司网站：<http://www.dxzq.net>

###### b、东兴证券股份有限公司网上直销系统

交易系统网址：<https://tradefund.dxzq.net/etrading/>

###### （2）东兴证券股份有限公司各分支机构

住所：北京西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 6 层

法人代表：魏庆华

联系人：田丰舞

电话：010-57307307

传真：010-57307388

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基金，并及时公告。

## 2、代销机构

### （1）北京汇成基金销售有限公司

公司网站：[www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

客服热线：400-619-9059

### （2）乾道金融信息服务（北京）有限公司

公司网站：[www.qiandaojr.com](http://www.qiandaojr.com)

客服热线：400-0888-080

### （3）大泰金石投资管理有限公司

公司网站：[www.dtfunds.com](http://www.dtfunds.com)

客服热线：400-9282-299

### （4）北京肯特瑞基金销售有限公司

公司网站：[fund.jd.com](http://fund.jd.com)

客服热线：95118

### （5）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

法定代表人：其实

联系人：丁珊珊

电话：010-65980408-8009

传真：010-65980408-8000

公司网址：[www.1234657.com.cn](http://www.1234657.com.cn)

### （6）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

法定代表人：杨文斌

联系人：胡轶隼

电话：021-2061 3635

传真：021- 6859 6916

公司网站：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

### （7）北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦二层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

电话：010-59601366-7024

公司网站：www.myfund.com

（8）北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 39 号第一上海中心 C 座 6 层

法定代表人：梁越

联系人：张晔

电话：010-58845312

公司网站：www.chtfund.com

（9）北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：高静

电话：010-59158281

传真：010-57569671

公司网站：www.qianjing.com

（10）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 楼

法定代表人：张跃伟

联系人：徐骋骁

电话：021-20691925

传真：021-20691861

公司网站：<http://www.erichfund.com/>

（11）粤开证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四  
楼

法定代表人：徐刚

联系人：彭莲

电话：(0752)2119700

公司网站：<http://www.lxq.com.cn>

（12）大连银行股份有限公司

公司网站：[www.bankofdl.com](http://www.bankofdl.com)

客服热线：400-664-0099

（13）上海利得基金销售有限公司

公司网站：[www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn)

客服热线：400-067-6266

（14）上海万得基金销售有限公司

公司网站：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

客服热线：400-821-0203

（15）上海基煜基金销售有限公司

公司网站：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

客服热线：400-820-5369

（16）方德保险代理有限公司

公司网站：[www.jhjhome.net](http://www.jhjhome.net)

客服热线：400-8557-333

（17）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

公司网站：<https://www.antfortune.com/>

客服热线：95188

（18）南京苏宁基金销售有限公司

公司网站：<https://www.snjijin.com/>

客服热线：95177

（19）深圳众禄基金销售股份有限公司

公司网站：<http://www.jjmmw.com/>



客服热线：4006-788-887

（20）北京植信基金销售有限公司

公司网站：<https://www.zhixin-iv.com/>

客服热线：4006-802-123

（21）济安财富（北京）基金销售有限公司

公司网站：<http://www.jianfortune.com/>

客服热线：400-673-7010

（22）上海联泰基金销售有限公司

公司网站：<http://www.66liantai.com/>

客服热线：400-166-6788

（23）珠海盈米基金销售有限公司

公司网站：<https://www.yingmi.cn/>

（24）嘉实财富管理有限公司

公司网站：<https://www.harvestwm.cn/>

客服热线：400-021-8850

（25）北京加和基金销售有限公司

公司网站：[www.bzfunds.com](http://www.bzfunds.com)

电话：010-50866175

（26）上海陆金所基金销售有限公司

公司网站：<http://www.lufunds.com/>

客服热线：400-8219-031

（27）大连网金基金销售有限公司

公司网站：<http://www.yibaijin.com/>

客服热线：4000-899-100

（28）北京蛋卷基金销售有限公司

公司网站：<https://danjuanapp.com/>

客服热线：4000-618-518

（29）天津万家财富基金销售有限公司

公司网站：<http://www.wanjiawealth.com/>

客服热线：010-59013895

（30）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

公司网址：<http://www.new-rand.cn/>

客服热线：4001661188

（31）江苏汇林保大基金销售有限公司

公司网址：[www.huilinbd.com](http://www.huilinbd.com)

客服热线：02566046166

（32）奕丰基金销售有限公司

公司网址：[www.ifastps.com](http://www.ifastps.com)

客服热线：4006840

## （二）登记机构

名称：东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）B 座 12、15 层

法定代表人：魏庆华

办公地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 6 层

联系人：王广辉

电话：010-57307359

传真：010-57307366

## （三）律师事务所

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

负责人：朱小辉

电话：010-57763888

传真：010-57763777

经办律师：吴冠雄、李晗

## （四）会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼

办公地址：北京市朝阳区针织路 23 号中国人寿金融中心 10 层

执行事务合伙人：曾顺福

联系电话：021-61418888

传真：010-85181218

经办注册会计师：李燕、邱丽

## 五、基金名称和基金类型

（一）本基金名称：东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金

（二）本基金类型：混合型证券投资基金

运作方式：契约型开放式

本基金存续期：不定期

## 六、基金的投资目标和投资方向

（一）投资目标

本基金主要投资受益于具有估值优势 and 良好成长性的潜力公司，通过合理的资产配置，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

（二）投资理念

本基金以中国经济新常态下具有巨大发展潜力的蓝海行业为投资主线，通过“自上而下”的趋势投资和“自下而上”的个股选择相结合的方法构建投资组合，深入研究通过产业升级以及创新发展实现价值创新的行业与公司，力求在严格控制风险的前提下，实现资产的长期稳健增值。

（三）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（含中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、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：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。如果法律法规变更或中国证监会允许，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。

## 七、基金的投资策略

本基金将根据对宏观经济周期和市场运行阶段的判断来确定投资组合中各大类资产的权重。在权益类资产投资方面，本基金将“自上而下”的趋势投资和“自下而上”的个股选择相结合。投资决策的重点在于寻找有巨大发展潜力的蓝海行业，并在行业内精选出具有竞争优势和估值优势的投资标的构建组合。本基金的“蓝海”投资范畴界定为：在新常态下通过产业升级以及创新发展实现价值创新的行业与公司。

### 1、资产配置策略

本基金使用趋势和估值相结合的方式，结合定量和定性分析，从多个角度考虑宏观经济面、政策面、市场面等多种因素，综合分析评判证券市场的特点及其演化趋势。在此基础上，来确定投资组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。

本基金考虑的宏观经济指标包括 GDP 增长率、居民消费价格指数(CPI)、生产者价格指数(PPI)、采购经理人指数（PMI）、货币供应量(M1，M2)的增长率等指标。

本基金考虑的市场因素包括但不限于市场的资金供求变化、上市公司的盈利增长情况、市场总体 P/E、P/B 等指标相对于长期均值水平的偏离度、经济增速相近的国家估值水平横向比较等多种指标，通过对上述指标的综合分析和研究实施投资组合的资产配置。

### 2、股票投资策略

#### （1）投资范畴界定

所谓蓝海就是亟待开发产业或市场空间，它代表着创新的需求，代表着高利润增长的机会，价值创新是蓝海战略的基石。在蓝海战略逻辑的指导下，企业不是把精力放在打败竞争对手上，而是放在全力为买方和企业自身创造价值飞跃上，

企业为客户创造了价值，同时也可以获得高额回报。

产业升级，从宏观方面理解，产业升级是国民经济结构综合资本、技术、供需结构、对外贸易结构等因素逐步由第一产业向第二产业移动，到达一定水平后再向第三产业转移的升级状态，转移的动力来自于各产业利润率的差异。从微观方面理解，企业内部积极进行技术创新，流程重组等，提升企业自身的生产效率，提高企业的价值；同一行业中的企业，在竞合机制的指引下，积极主动地转产，生产市场需要的某种商品或退出某种商品的生产，或者进行资产重组，通过兼并、接管、破产、倒闭等方式寻求资源的有效利用。

创新驱动，激发经济增长的新活力。当前，我国依靠要素成本优势所驱动、大量投入资源和消耗环境的经济发展方式已经难以为继，经济增长从要素驱动、投资驱动转向创新驱动将成为经济的新常态，创新驱动的发展战略将增强科技创新对经济增长的贡献度，高新技术产业、新能源汽车、信息产业、生物医药、新材料、现代服务业、海洋产业等直接相关的产业，将成为新的增长动力源泉。

## （2）行业配置策略

本基金的行业配置，重点在于寻找有巨大发展潜力的蓝海行业，通过对经济运行周期、行业竞争态势以及国家产业政策调整等因素进行分析和研究，筛选具有巨大发展趋势的行业资产进行配置，并依据各行业的景气度情况以及估值水平等因素，对行业配置权重进行动态调整。

## （3）个股精选策略（定性分析、定量分析）

### 定量筛选：

主要使用贴现现金流量法、现金分红折现法、剩余收入折现法、PE、EV/EBIT 等估值方法对不同类型的产业和个股进行估值分析，并与其市场价格相比较，参考国内同类企业和国外可比同类企业的估值水平，选择具有估值优势的股票形成股票备选库。

### 定性筛选：

从以下两个方面对股票备选库中的股票进行定性分析：

公司评价：主要包括分析公司竞争力、财务状况、发展战略、创新能力、公司治理、股东背景等方面

业务分析：主要包括对公司的业务进行逐项分析，包括所涉及业务的投资效

率、行业前景、公司的市场地位、行业增长、公司增长等方面。

### 3、债券投资策略

本基金结合对国内外宏观经济基本面、金融市场运行趋势、市场资金面情况及市场供求、债市收益率水平、期限利差及信用利差等各方面的分析，制定组合动态配置策略的基础上，合理安排基金组合中债券投资组合的久期及期限结构，结合内部研究和信用评级积极优选个券进行投资，以获取稳健的投资收益。

### 4、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具。管理人将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型确定其合理估值水平，根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性，通过限量投资、趋势投资、优化组合等投资策略进行权证投资。

### 5、资产支持证券投资策略

资产支持证券的定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金管理人通过考察宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素，预判资产池未来现金流变动；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，同时密切关注流动性变化对标的证券收益率的影响，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

### 6、股指期货投资策略

本基金对于股指期货的投资是以对当前投资组合进行套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约作为投资标的。通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻找其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，谨慎投资，以降低投资组合的整体风险。

## 八、基金的业绩比较基准

沪深 300 指数收益率\*60%+中债综合指数收益率\*40%

沪深 300 指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数；该指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，不易被操纵，

并且有较高的知名度和市场影响力，适合作为本基金股票投资的业绩比较基准。

中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，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），能够很好的反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势，适合作为本基金债券投资的业绩比较基准。

如果今后证券市场中有其他代表性更强，或者指数编制单位停止编制该指数，或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况在按照监管部门要求履行适当的程序并经基金托管人同意后对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管理人应在调整前在指定媒体上予以公告，而无需召开基金份额持有人大会。

本基金的业绩比较基准仅作为衡量本基金业绩的参照，不决定也不必然反映本年基金的投资策略。

## 九、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。

## 十、基金的投资组合报告

以下内容摘自本基金 2020 年第 1 季度报告（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	权益投资	62,450,465.89	68.36
	其中：股票	62,450,465.89	68.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,004,500.00	5.48
	其中：债券	5,004,500.00	5.48
	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	18,000,000.00	19.70
	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	5,682,611.95	6.22
8	其他资产	215,091.17	0.24
9	合计	91,352,669.01	100.00

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	2,800,736.00	3.11
C	制造业	20,824,834.58	23.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,183,653.00	2.42
F	批发和零售业	19,147.31	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	877,866.00	0.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	570,546.00	0.63
J	金融业	32,321,845.00	35.86
K	房地产业	1,504,293.00	1.67
L	租赁和商务服务业	759,360.00	0.84
M	科学研究和技术服务业	588,185.00	0.65
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	62,450,465.89	69.28

### 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	601318	中国平安	110,300	7,629,451.00	8.46
2	600519	贵州茅台	5,700	6,332,700.00	7.03
3	600036	招商银行	116,600	3,763,848.00	4.18
4	600276	恒瑞医药	36,800	3,386,704.00	3.76
5	601166	兴业银行	176,000	2,800,160.00	3.11
6	600887	伊利股份	90,600	2,705,316.00	3.00
7	601628	中国人寿	97,800	2,576,052.00	2.86
8	601988	中国银行	657,600	2,288,448.00	2.54
9	600030	中信证券	88,500	1,961,160.00	2.18
10	600016	民生银行	303,000	1,730,130.00	1.92

### 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	5,004,500.00	5.55
	其中：政策性金融债	5,004,500.00	5.55
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	5,004,500.00	5.55

**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	108602	国开1704	50,000	5,004,500.0 0	5.55
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

**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**

本基金本报告期内未投资股指期货。

**10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期内未投资国债期货。

**11. 投资组合报告附注****11.1**

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

**11.2**

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	23,732.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	191,358.98

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	215,091.17

#### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 11.5 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。

### 十一、基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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12月23日（基金合同生效日）至2015年12月31日	-0.80%	0.38%	-2.15%	0.73%	1.35%	-0.35%
2016年1月1日至2016年12月31日	-21.77%	1.44%	-7.42%	0.84%	-14.35%	0.60%
2017年1月1日至2017年12月31日	4.90%	0.77%	11.70%	0.38%	-6.80%	0.39%
2018年1月1日至2018年12月31日	-28.38%	1.14%	-13.27%	0.80%	-15.11%	0.34%
2019年1月1日至2019年12月31日	22.13%	1.03%	22.17%	0.74%	-0.04%	0.29%
2020年1月1日至2020年3月31日	-7.58%	1.28%	-5.27%	1.15%	-2.31%	0.13%

### 十二、费用概览

#### （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、除法律法规、中国证监会另有规定外，《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、仲裁费和和诉讼费；
- 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、基金的开户费用、账户维护费用；
- 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。

## （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

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

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 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、公休假等，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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 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“（一）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。

（三）不列入基金费用的项目

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；

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）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。

### 十三、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他法律法规的要求，对本基金原招募说明书（更新）（2020 年第 2 号）进行了更新，主要更新内容如下：

（一）更新了“重要提示”中内容更新截止日。

（二）更新了“三、基金管理人”中相关内容。

（三）更新了“四、基金托管人”中相关内容。

（四）更新了“五、相关服务机构”中相关内容。

（五）更新了“八、基金的投资”中“基金的投资组合报告”，该部分内容均按有关规定编制，并经本基金托管人复核，但未经审计。

（七）更新了“九、基金的业绩”中相关内容，该部分内容均按有关规定编制，并经托管人复核，但未经审计。

（八）更新了“二十一、其他应披露事项”，披露了自上次《招募说明书（更新）》截止日 2019 年 6 月 23 日到本次《招募说明书（更新）》内容截止日 2020 年 6 月 23 日之间涉及本基金的相关公告。

上述内容仅为本基金更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书详细内容，可登录东兴证券股份有限公司网站

<http://www.dxzq.net>。

东兴证券股份有限公司

2020 年 7 月 31 日