

**东兴众智优选灵活配置混合型
证券投资基金
招募说明书（更新）摘要
2018 年第 1 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

重要提示

东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2016年2月14日经中国证券监督管理委员会证监许可【2016】268号文注册募集。本基金合同于2016年6月13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。投资者认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

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，属于中高风险、中高收益的投资品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，但高于债券型基金和货币市场基金。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交易的股票（包括中小板、创业板和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、超短期融资券等）、货币市场工具、次级债、债券回购、银行存款、资产支持证券、权证、股指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和基金合同，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。

基金管理人股权结构以及有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 9 月 30 日,有关财务数据未经审计。本招募说明书其他所载内容截止日为 2017 年 12 月 13 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》)、《公开募集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

2016 年 6 月 13 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)B 座 12、15 层

办公地址: 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

组织形式: 股份有限公司

联系电话: 010-66551816

联系人: 陈智勇

注册资本: 275796.0657 万元人民币

股权结构: (截止 2017 年 9 月末)

序号	股东名称	持股数量(万股)	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	中国证券金融股份有限公司	132,467,728	4.80
3	山东高速股份有限公司	119,989,367	4.35
4	上海国盛集团资产有限公司	96,973,366	3.52
5	福建天宝矿业集团股份有限公司	76,530,568	2.77

（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，闽发证券有限责任公司三明支公司总经理，闽发证券有限责任公司副总裁、总裁，东兴证券副总经理；现任东兴证券董事长、总经理、财务负责人，东兴资本投资管理有限公司董事长，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，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国银行股份有限公司国际业务部科员、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、资产经营部副总经理，邦信资产管理有限公司副总经理，中国东方人力资源部副总经理。2012 年 10 月至今任东兴证券副董事长，现兼任东兴证券（香港）金融控股有限公司董事长。

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。曾任职于中国银行股份有限公司，中国东方股权及投行业务部、市场开发部、总裁办公室、研发中心。2010 年 5 月至 2011 年 11 月任中国东方研发中心副总经理；2011 年 11 月至 2013 年 1 月任中国东方研发中心总经理；2013 年 1 月至今任中国东方战略发展规划部总经理。2016 年 1 月至今任东兴证券董事。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。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；2016 年 8 月至今任中国东方董事会办公室副总经理（主持工作），兼任东富（天津）股权投资基金管

理有限公司董事。2017 年 3 月至今任东兴证券董事。

邵晓怡女士，1976 年 9 月出生，硕士研究生学历，高级会计师。曾任职于中国建设银行北京城建支行、信永中和会计师事务所有限公司、普华永道中天会计师事务所有限公司、中国财产再保险股份有限公司。2010 年 9 月至 2016 年 9 月历任中国东方财务会计部制度处经理、高级经理、财务会计部助理总经理；2016 年 9 月至 2017 年 11 月任中国东方综合计划与战略协同部副总经理，现就职于中华联合保险集团股份有限公司，兼任中国外贸金融租赁有限公司董事、大业信托有限责任公司监事。2017 年 3 月至今任东兴证券董事。

黎蜀宁女士，1968 年 8 月出生，博士研究生学历。曾就职于重庆大渡口律师事务所、重庆海证律师事务所；曾任中国东方重庆办事处资产处置审查办公室副经理、重庆办事处风险管理部法律分部经理、重庆办事处风险管理部经理、重庆办事处助理总经理兼党委委员、武汉办事处助理总经理兼党委委员、重庆办事处副总经理兼党委委员、重庆市分公司副总经理兼党委委员。2016 年 11 月至今任中国东方法律合规部副总经理（主持工作），兼任浙江融达企业管理有限公司董事。2017 年 6 月至今任东兴证券董事。

屠旋旋先生，1973 年 8 月出生，大学本科，经济师。屠旋旋先生曾就职于中国银行上海市分行、中国东方上海办事处，上海大盛资产有限公司；曾任上海国盛（集团）有限公司资产管理中心副主任、上海国盛资产经营部总经理、总裁助理；现任上海国盛集团资产有限公司副总裁，上海盛翰投资有限公司执行董事，上海正浩资产管理有限公司董事长，湖南外商国际活动中心有限公司董事长，湖南青竹湖活力养老社区实业有限公司董事长，上海金煤化工新技术有限公司董事，上海实久公司总经理。2007 年 8 月至今任东兴证券董事会董事。

张震先生，1975 年 5 月出生，博士研究生学历，高级经济师。曾任山东高速股份有限公司董事会秘书处处长助理，董事会秘书；山东高速实业发展有限公司总经理；山东高速投资发展有限公司总经理。现任山东高速服务区管理有限公司总经理。2017 年 3 月至今任东兴证券董事。

郑振龙先生，1966 年 3 月出生，博士研究生，厦门大学经济学院教授。在金融工程、资产定价、利率期限结构和金融危机等领域有丰富的研究成果。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）。现任厦门大学闽江学者特聘教授、国务院学位委员会学科评议组成员，享受国务院政府特殊津贴，兼任华福证券独立董事，厦门国际银行股份有限公司独立董事、华通银行独立董事。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。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月至今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。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、宁波创源文化发展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。

孙广亮先生，1963年7月出生，本科学历，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，现任北京市华堂律师事务所合伙人律师、主任，大商股份有限公司独立董事、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

许向阳先生，1965年7月出生，本科学历，律师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国政法大学讲师，国家经济体制改革委员会政策法规司副处长、处长，中国银行股份有限公司法律部处长，中国东方资产管理公司总裁办公室、资产处置审查办公室副总经理，哈尔滨办事处、法律事务部、机构管理部总经理。2011年7月至今任东兴证券监事会主席。

叶淑玉女士，1957年5月生，中欧EMBA，物理学学士，高级工程师、会计师。曾任福州无线电七厂质检科副科长兼厂团总支书记；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。现任东煌企业集团董事局主席助理，福建大东煌集团股份有限公司董事，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。

罗小平先生，1960 年 5 月出生，硕士研究生，高级经济师。曾就职于天津远洋运输公司；曾任中国海员对外技术服务公司驻香港代表处代表；华夏证券股份有限公司投行部、并购部、证券营业部总经理；中华企业咨询有限公司执行总裁；诚通控股战略发展中心总监。现任中国诚通控股集团有限公司专职派出董事、中国物流有限公司派出董事、中国诚通香港有限公司派出董事。2011 年 11 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，中国国籍，无境外永久居留权。曾任信达资产管理公司财务部会计，宏源证券股份有限公司财务部总经理助理、副总经理，现任东兴证券财务部总经理，兼任东兴证券投资有限公司董事、东兴期货有限责任公司董事。2017 年 3 月至今任东兴证券职工监事。

杜彬先生，1973 年 2 月出生，本科学历，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于中国人民银行；曾任中国民族国际信托投资公司国际业务部副经理、资产管理部总经理，中国民族证券有限责任公司法律及合规政策部经理，合规部副总经理、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、东兴证券投资有限公司董事、东兴期货有限责任公司监事。2014 年 8 月至今任东兴证券职工监事。

3、总经理及其他高级管理人员

魏庆华先生和谭世豪先生，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，东兴证券副总经理，东兴证券合规总监兼任首席风险官。2015 年 9 月至今任东兴证券副总经理，现兼任东兴证券合规总监，东兴资本投资管理有限公司董事，东兴证券（香港）金融控股有限公司董事。

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，中信建投证券有限责任公司研究所所长助理，东兴证券研究所总经理，东兴证券助理总经理兼研究所、机构业务部总经理、资产管理业务总部总经理。2011 年 8 月至今任东兴证券副总经理，现兼任东兴证券衍生品部总经理，东兴期货有限责任公司董事长，东兴财富资产管理有限公司董事长。

孙小庆先生，1964 年 9 月出生，本科学历，工程师，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安徽省分行；曾任中国东方资产管理公司合肥办事处高级主任、副经理、助理总经理，闽发证券有限责任公司清算组副组长，东兴证券助理总经理。2012 年 6 月至今任东兴证券副总经理，现兼任东兴证券融资融券部总经理。

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。曾任中诚信托投资有限责任公司信托经理，中国证券监督管理委员会发行监管部审核一处科员、副调研员、副处长。2015 年 9 月至今任东兴证券首席风险官，现兼任东兴证券（香港）金融控股有限公司董事。

刘亮先生，1974 年 10 月出生，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，中国证监会福建监管局，曾任中国证监会福建监管局主任科员、副处长、处长，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。2013 年 9 月至今任东兴证券董事会秘书，现兼任副总经理、董事会办公室总经理、深圳分公司总经理。

陈海先生，1970 年 12 月出生，本科学历。曾就职于闽发证券有限责任公司；曾任闽发证券有限责任公司深圳营业部会计主管，福州五一中路营业部分析师，总部信息研究中心股评部经理，总部资产管理部闽南分部总经理，福州北环东路营业部助理总经理；东兴证券股份有限公司江厝路营业部总经理，福建分公司副总经理，助理总经理兼资产管理业务总部业务一部总经理；2016 年 11 月至今任东兴证券副总经理，现兼任东兴证券（香港）金融控股有限公司董事、东兴证券（香港）有限公司董事。

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

程远，北京工商大学金融工程专业毕业，具有 7 年证券行业从业经验。2008 年进入东兴证券投资银行总部工作，2009 年任东兴证券研究所任纺织服装行业高级研究员，2011 年任华泰证券（原华泰联合）研究所纺织服装研究组组长，2013 年任华泰证券纺织服装组组长兼任轻工造纸组和旅游酒店组组长，2015 年任东兴证券基金业务部研究总监。

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。

程远先生，现任基金业务部研究总监。

孙继青先生，现任基金业务部基金经理。

吕姝仪女士。

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：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

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 (ISAE3402) 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2016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。

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, 2014年更名为托管业务部/养老金管理中心, 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。

（二）、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近140名，其中具有高级职称的专家30余名，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。

（三）、基金托管业务经营情况

截止到2017年9月30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415只。

（四）基金托管人的内部控制制度

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。

（五）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：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦12层

联系人：陈智勇

直销中心电话：010-6655-1816

传真：010-66551452

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

办公地址：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：010-66551707

传真：010-66551452

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

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

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

客服热线：400-9282-299

（4）北京新浪仓石基金销售有限公司

公司网站：www.xincai.com

客服热线：86-10-62675369

（5）上海长量基金销售投资顾问有限公司

公司网站：www.erichfund.com

客服热线：400-820-2899

（6）上海天天基金销售有限公司

公司网站：www.1234567.com.cn

客服热线：400-1818-188

（7）上海好买基金销售有限公司

公司网站：www.ehowbuy.com

客服热线：400-7009-665

（8）联讯证券股份有限公司

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

客服电话：95564

公司网站: www.lxzq.com.cn

(9) 大连银行股份有限公司

公司网站: www.bankofdl.com

客服热线: 400-664-0099

(10) 上海利得基金销售有限公司

公司网站: www.leadfund.com.cn

客服热线: 400-067-6266

(11) 上海万得投资顾问有限公司

公司网站: www.520fund.com.cn

客服热线: 400-821-0203

(12) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

公司网站: fund.jd.com

客服热线: 95118

(13) 上海基煜基金销售有限公司

公司网站: www.jiyufund.com.cn

客服热线: 400-820-5369

(14) 金惠家保险代理有限公司

公司网站: www.jhjhome.net

客服热线: 400-8557-333

(15) 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

(16) 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

(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：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 12 层

联系人：王广辉

电话：010-66551599

传真：010-66551452

（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：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城西二办公楼 8 层 10 室

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城西二办公楼 8 层 10 室

执行事务合伙人：崔劲

联系电话：010-85207108

传真：010-85181218

经办注册会计师：李燕、李瑶帆

五、基金名称和基金类型

（一）本基金名称：东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金

(二) 本基金类型：混合型

运作方式：契约型开放式

六、基金的投资目标和投资方向

(一) 投资目标

本基金主要以行业、公司基本面研究为基础，精选具有估值优势和成长潜力的公司进行投资，力争获取超越业绩比较基准的收益，在严格控制下行风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。

(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交易的股票（含中小板股票、创业板股票，以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、超短期融资券等）、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具、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

本基金管理人采用主要以行业、公司基本面研究为基础，筛选具有估值优势和成长潜力的公司进行投资。

本基金的投资策略主要有以下六方面内容：

1、大类资产配置策略

在大类资产配置中，本基金综合运用定性和定量的分析手段，在对宏观经济因

素进行充分研究的基础上，判断宏观经济周期所处阶段。本基金将依据经济周期理论，结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估，制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例。

本基金将根据经济运行周期变动、市场利率变化、市场估值、证券市场变化等因素以及基金的风险评估，灵活调整基金投资组合中股票等权益类、债券等固定收益类和现金资产的比例。

2、股票投资策略

本基金主要以行业、公司基本面研究为基础，主要考虑的方面包括：行业发展趋势、行业竞争格局、上市公司核心竞争力、上市公司治理结构、议价能力、市场占有率、成长性、盈利能力、运营效率、财务结构、现金流情况等公司基本面因素，同时强调上下游产业链实地调研对研究逻辑和结论的验证。从中国资本市场行为特征出发，把握市场定价偏差带来的投资机会。本基金的股票投资采取行业配置与“自下而上”的个股精选相结合的方法，以深入的基本面研究为基础，精选具有持续成长能力、价值被低估的上市公司股票。”。

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

本基金的业绩比较基准为：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，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，根据实际情况在履行适当的程序并经基金托管人同意后将业绩比较基准进行相应调整，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

基金管理人的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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年1月3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始于2017年07月01日，截止2017年09月30日。

1. 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	138,199,797.04	92.84
	其中：股票	138,199,797.04	92.84
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	10,525,480.73	7.07
8	其他资产	132,526.93	0.09
9	合计	148,857,804.70	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	70,071,513.15	47.26
D	电力、热力、燃气及 水生产和供应业	31,093.44	0.02
E	建筑业	11,834,842.20	7.98
F	批发和零售业	26,385.45	0.02
G	交通运输、仓储和邮 政业	7,384,404.66	4.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信 息技术服务业	17,066,768.03	11.51
J	金融业	11,698,560.00	7.89
K	房地产业	8,142,625.80	5.49
L	租赁和商务服务业	79,324.72	0.05
M	科学研究和技术服务 业	7,460,100.00	5.03
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	115,299.99	0.08
R	文化、体育和娱乐业	40,879.60	0.03
S	综合	4,248,000.00	2.87
	合计	138,199,797.04	93.21

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	000018	神州长城	1,499,980	11,834,842.20	7.98
2	601318	中国平安	216,000	11,698,560.00	7.89
3	600438	通威股份	1,160,000	10,938,800.00	7.38
4	601700	风范股份	1,299,037	9,690,816.02	6.54
5	600634	中技控股	470,000	8,812,500.00	5.94
6	300248	新开普	480,000	8,236,800.00	5.56
7	002366	台海核电	290,000	8,218,600.00	5.54
8	002147	新光圆成	623,956	8,142,625.80	5.49
9	002102	冠福股份	1,980,000	7,801,200.00	5.26
10	300125	易世达	270,000	7,460,100.00	5.03

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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

单位：人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	79,714.86
2	应收证券清算款	49,397.82
3	应收股利	-
4	应收利息	3,414.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	132,526.93

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的情况。

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。

1. 本报告期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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月	5.38%	0.56%	2.71%	0.35%	2.67%	0.21%
-------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

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：1、本基金基金合同生效日为2016年6月13日，建仓期为6个月，截至本报告期末距建仓期结束不满一年；

2、建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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、《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 0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

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；
- 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纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十三、其他应披露事项

一、本基金的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的内容与格式进行披露，并在指定媒介上公告。

二、本招募说明书将按中国证监会有关规定定期进行更新。招募说明书解释与基金合同不一致时，以基金合同为准。

三、从上次《招募说明书》截止日 2017 年 6 月 13 日到本次《招募说明书（更新）》截止日 2017 年 12 月 13 日之间的信息披露事项。

公告名称	公告时间
东兴证券股份有限公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	2017/06/20
东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金半年度最后一个市场交易日净值公告	2017/07/01
东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	2017/07/04
东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	2017/07/19
东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2017 年第 2 号）	2017/07/28
东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要 2017 年第 2 号	2017/07/28
东兴证券股份有限公司关于以通讯方式召开东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	2017/08/02

东兴证券股份有限公司关于以通讯方式召开东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	2017/08/03
东兴证券股份有限公司关于以通讯方式召开东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	2017/08/04
东兴证券股份有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	2017/08/09
关于增加南京苏宁基金销售有限公司为东兴证券股份有限公司公开募集证券投资基金的销售机构并参与其费率优惠活动的公告	2017/08/09
东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	2017/08/09
东兴证券股份有限公司关于旗下部分基金持有的停牌股票估值调整的提示性公告	2017/08/15
东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告	2017/08/24
东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要	2017/08/24
东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同	2017/09/05
东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议	2017/09/05
东兴证券股份有限公司关于召开东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	2017/09/05
关于增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为东兴证券股份有限公司公开募集证券投资基金的销售机构并参与其费率优惠活动的公告	2017/09/15
东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第三季度报告	2017/10/27
东兴证券股份有限公司关于旗下部分基金持有的停牌股票估值调整的提示性公告	2017/11/24

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》及其他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进行了更新，主要内容如下：

（一）在“重要提示”中，新增了“招募说明书有关财务数据的截止日期”及

“其他内容的截止日期”及相关文字表述。

（二）在“三、基金管理人”部分，对基金管理人的相关内容进行了更新。

（三）在“四、基金托管人”部分，对基金托管人的相关内容进行了更新。

（四）在“五、相关服务机构”部分，对服务机构的相关内容进行了更新。

（五）在“七、基金份额的申购、赎回与转换”部分，更新了赎回费归入基金财产比例。

（六）在“八、基金的投资”部分，对基金投资目标、投资策略、投资组合的相关内容进行了更新。

（七）在“九、基金的业绩”部分，对基金业绩的相关内容进行了更新。

（八）在“十三、基金的费用与税收”部分，更新了管理费、托管费。

（九）在“十八、基金合同的内容摘要”部分，更新了基金管理人、基金托管人的相关信息。

（十）在“十九、基金托管协议的内容摘要”部分，更新了基金管理人的相关内容。

（十一）在“二十一、其他应披露事项”部分，更新了从本基金上次《招募说明书》截止日 2017 年 6 月 13 日至本次《招募说明书（更新）》截止日 2017 年 12 月 13 日之间的信息披露事项。

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

2018 年 1 月 27 日