

# 东吴新产业精选股票型证券投资基金 更新招募说明书摘要

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

## 【重要提示】

本基金根据【2011】年【6】月【27】日中国证券监督管理委员会《关于同意东吴新产业精选股票型证券投资基金募集的批复》（证监基金字【2011】【1021】号）的核准，进行募集。本基金的基金合同于2011年9月28日正式生效。

本摘要根据基金合同和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《基金法》、《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，应详细查阅基金合同。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

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》及《基金合同》。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2013年09月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2013年06月30日。（财务数据未经审计）

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

1. 名称：东吴基金管理有限公司
2. 住所：上海市浦东新区源深路279号(200135)
3. 办公地址：上海市浦东新区源深路279号(200135)
4. 法定代表人：任少华
5. 设立日期：2004年9月2日
6. 批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字【2003】82号
7. 组织形式：有限责任公司（国内合资）

8. 注册资本：1 亿元人民币
9. 联系人：吴靖
10. 电话：(021) 50509888
11. 传真：(021) 50509884
12. 客户服务电话：400-821-0588（免长途话费） 021 - 50509666
13. 公司网址：www.scfund.com.cn
14. 股权结构：

持股单位	出资额(万元)	占总股本比例
东吴证券股份有限公司	4900	49%
上海兰生（集团）有限公司	3000	30%
江阴澄星实业集团有限公司	2100	21%
合 计	10,000	100%

15. 简要情况介绍：

东吴基金管理有限公司设立投资管理部、固定收益部、专户投资部、量化投资部、研究策划部、集中交易室、营销管理部、北京营销中心、上海营销中心、广州营销中心、产品策略部、营销策划部、理财中心、总经理办公室（下设四个二级部门，分别为综合管理部、人力资源部、战略规划部与行政事务部）、基金事务部、信息技术部、北京办事处、财务管理部和监察稽核部等 19 个职能部门。公司已管理的第一只产品东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金，于 2005 年 2 月 1 日基金合同生效，托管行为中国工商银行股份有限公司。公司已管理的第二只产品东吴价值成长双动力股票型证券投资基金，于 2006 年 12 月 15 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第三只产品东吴行业轮动股票型证券投资基金，于 2008 年 4 月 23 日基金合同生效，托管行为华夏银行股份有限公司。公司已管理的第四只产品东吴优信稳健债券型证券投资基金，于 2008 年 11 月 5 日基金合同生效，托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第五只产品东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金，于 2009 年 5 月 6 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第六只产品东吴新经济股票型证券投资基金，于 2009 年 12 月 30 日基金合同生效，托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第七只产品东吴货币市场证券投资基金，于 2010 年 5 月 11 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第八只产品东吴新创业股票型证券投资基金，于 2010 年 6 月 29 日基金合同生效，托管行为中国工商银行股份有限公司。公司已管理的

第九只产品东吴中证新兴产业指数证券投资基金，于 2011 年 2 月 1 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第十只产品东吴增利债券型证券投资基金，于 2011 年 7 月 27 日基金合同生效，托管行为中信银行股份有限公司。公司已管理的第十一只产品东吴新兴产业精选股票型证券投资基金，于 2011 年 9 月 28 日基金合同生效，托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第十二只产品东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF），于 2012 年 3 月 9 日基金合同生效，托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第十三只产品东吴保本混合型证券投资基金，于 2012 年 8 月 13 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第十四只产品东吴内需增长混合型证券投资基金，于 2013 年 1 月 30 日基金合同生效，托管行为交通银行股份有限公司。公司已管理的第十五只产品东吴鼎利分级债券型证券投资基金，于 2013 年 4 月 25 日基金合同生效，托管行为交通银行股份有限公司。

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

吴永敏先生，董事长，硕士研究生，高级审计师、高级经济师，中共党员。历任苏州市财政局科员、苏州市税务局三分局局长、苏州市税务局科长、苏州市审计局副局长。现任东吴证券股份有限公司董事长，中共东吴证券股份有限公司党委书记。

金燕萍女士，副董事长，大学，高级政工师，中共党员。历任上海外贸总公司党委委员、党委办公室副主任，上海海外公司党总支书记，上海广告公司党委副书记、副总经理，上海实业（集团）有限公司办事处常务副主任、党总支书记。现任上海兰生（集团）有限公司总裁助理兼投资管理部总经理。

任少华先生，董事，博士研究生，经济师，中共党员。历任苏州市人民检察院助理检查员，苏州中辰期货公司总经理助理，苏州证券投资部总经理、资产管理部总经理、副总经济师，东吴证券股份有限公司资产管理总部总经理、总经济师、总裁助理兼任期货筹备组组长、研究所所长，东吴证券股份有限公司党委委员、副总裁，东吴期货有限公司董事长。现任东吴基金管理有限公司总经理。

吴亮先生，董事，硕士，经济师，中共党员。历任农行无锡分行国际业务部综合部副经理、农行无锡锡山支行国际业务部经理、农行无锡分行国际业务部副总经理，农行江阴市支行副行长，现任江阴澄星实业集团有限公司副总裁。

王金来先生，董事，大学，经济师，中共党员。历任苏州市二轻局秘书，苏州市经济体

制改革委员会副科长、处长、助理调研员，兼苏州市证券期货监督管理办公室证券处处长和苏州市企业上市工作办公室证券处处长，东吴证券股份有限公司投行总部副总经理，东吴证券股份有限公司董事长助理兼行政总监。现任东吴证券股份有限公司顾问。

戴继雄先生，董事，硕士，历任上海复星高科技（集团）有限公司财务、审计副总监，现担任上海兰生（集团）有限公司财务副总监、财务金融部总经理。

贝政新先生，独立董事，大学，教授，博士生导师。历任苏州大学商学院财经学院讲师、副教授。现任苏州大学商学院财经学院教授，博士生导师。

张平先生，独立董事，教授，博士生导师。历任中国社科院经济研究所研究员、所长助理，现任中国社科院经济研究所副所长，中国社科院研究生院教授、博士生导师。

陈如奇先生，独立董事，大专学历，中共党员，高级经济师。历任新疆人民银行巴州中心支行科员，新疆农业银行巴州及自治区分行科长、处长，交通银行上海分行处长、副行长，交通银行广州分行行长，交通银行香港分行总经理等职。

## 2、监事会成员

沈国强先生，监事长，大专，经济师。历任人民银行盐城分行、苏州分行科员，工商银行苏州分行咨询部主任，苏州证券业务部、经济管理部、研究发展中心、投行总经理，苏州证券经纪总监兼经纪管理部、研究发展中心总经理，苏州证券总裁助理兼市场发展部总经理，苏州证券公司、苏州证券有限责任公司两届监事，东吴证券监事会主席兼总裁助理、稽核部负责人，东吴证券监事会主席、稽核部负责人。

周忠明先生，监事，硕士研究生，会计师，中共党员。曾任江苏澄星磷化工股份有限公司副总经理兼财务总监、董事长，现任江阴澄星实业集团有限公司副总裁。

黎瑛女士，员工监事，硕士研究生，经济师，中共党员。曾就职于上海证券综合研究有限公司、长城证券有限责任公司，现任东吴基金管理有限公司研究总监兼研究策划部总经理。

## 3、高管人员

吴永敏先生，董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）

任少华先生，总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

王炯先生，常务副总经理、硕士研究生，经济师，中共党员。历任苏州市统计局综合平衡处科员、苏州证券西北街营业部业务主管、东吴证券办公室副主任、总裁办公室主任、机构客户部总经理、总裁助理等职务，现任东吴基金管理有限公司常务副总经理。

徐军女士，督察长，大学，会计师、审计师，中共党员。历任苏州市审计局财政、金融审计处科员、副处长，东吴证券财务部总经理，东吴基金管理有限公司财务负责人、公

司总裁助理等职务，现任东吴基金管理有限公司督察长。

#### 4. 基金经理

历任基金经理：

任壮，1972年生，毕业于东北林业大学，管理学博士，中国社科院金融所博士后，副研究员，八年证券从业经历。曾任兴业证券研发中心高级研究员；2007年9月加入东吴基金管理有限公司，曾任公司基金经理助理、研究策划部总经理助理、公司研究副总监兼研究策划部副总经理、东吴新经济股票基金基金经理等职，现担任公司权益类投资副总监兼东吴行业轮动股票基金基金经理。自2011年9月28日起任本基金基金经理。

现任基金经理：

刘元海先生，1976年生，同济大学管理学博士，九年证券从业经历，2004年2月加入东吴基金管理有限公司，曾任研究策划部研究员、基金经理助理等职，现担任东吴新产业精选股票基金经理、东吴内需增长混合型证券投资基金经理。自2011年10月26日起担任本基金基金经理。

#### 5. 投资决策委员会成员

任少华 公司总经理；

程涛 公司总经理助理兼首席投资官；

黎瑛 公司研究总监兼研究策划部总经理；

唐祝益 公司权益类投资总监兼投资管理部总经理；

任壮 公司权益类投资副总监；

丁蕙 固定收益部总经理；

凌鹏 公司研究副总监兼专户投资部副总经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### (一) 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：田青

联系电话：(010) 6759 5096

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的历史，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2013年6月30日，中国建设银行资产总额148,592.14亿元，较上年末增长6.34%。2013年上半年，中国建设银行实现净利润1,199.64亿元，较上年同期增长12.65%。年化资产回报率为1.66%，年化加权净资产收益率为23.90%。利息净收入1,876.60亿元，较上年同期增长10.59%。净利差为2.54%，较上年同期提高0.01个百分点。净利息收益率为2.71%，与上年同期持平。手续费及佣金净收入555.24亿元，较上年同期增长12.76%。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构，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、悉尼、台北设有10家一级海外分行，拥有建行亚洲、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建银国际等5家全资子公司，海外机构已覆盖到全球14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27家，拥有建信基金、

建信租赁、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。

2013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近30个重要奖项。在英国《银行家》杂志2013年“世界银行1000强排名”中位列第5，较上年上升1位；在美国《财富》世界500强排名第50位，较上年上升27位；在美国《福布斯》2013年全球2000强上市企业排行榜中位列全球第2，较上年提升11位。此外，本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、投资者关系和企业社会责任等领域的多个专项奖。

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225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。

## （二）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。

## （三）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2013年6月30日，中国建设银行已托管311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年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》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“最佳资产托管银行”奖，和境内权威经济媒体《每日经济观察》2012年度“最佳基金托管银行”奖。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）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。

### （二）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。

### （三）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

### （一）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。

## （二）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。

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

（1）东吴基金管理有限公司直销中心

注册地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

法定代表人：任少华

联系人：吴靖

直销电话：（021）50509880

传真：（021）50509884

客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、（021）50509666

网站：[www.scfund.com.cn](http://www.scfund.com.cn)

## (2) 网上交易

个人投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

网上交易网址：[www.scfund.com.cn](http://www.scfund.com.cn)

## 2、代销机构

### (1) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：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

联系人：张静

传真：(010) 66275654

客服电话：95533

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

### (2) 中信银行股份有限公司

注册地址：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：田国立

联系人：郭伟

电话：010-65557048

传真：010-65550827

客服电话：95558

公司网址：<http://bank.ecitic.com>

### (3) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：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

联系人：刘峰

电话：(010) 85108226

传真：(010) 85109219

客服电话：95599

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

**(4) 中国工商银行股份有限公司**

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100005）

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100005）

法定代表人：姜建清

联系人：查樱

传真：(010) 66105662

客服电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

**(5) 交通银行股份有限公司**

注册地址：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：牛锡明

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408483

客服电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

**(6) 华夏银行股份有限公司**

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

法定代表人：吴建

联系人：李慧

电话：(010) 85238670

传真：(010) 85238680

客户服务电话：95577

公司网址：www.hxb.com.cn

**(7) 招商银行股份有限公司**

注册地址：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：傅育宁

联系人：邓炯鹏

电话：(0755) 83198888

传真：(0755) 83195049

客服电话：95555

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

**(8) 中国民生银行股份有限公司**

注册地址：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：杨成茜

电话：(010)57092619

传真：(010)57092611

客服电话：95568

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

**(9) 宁波银行股份有限公司**

注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号宁波银行大楼

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

电话：(0574) 89068340

传真：(0574) 87050024

客服电话：96528，上海地区 962528

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

**(10) 平安银行股份有限公司**

注册地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：张莉

电话：021-38637673

客服电话：40066-99999（免长途费）0755-961202

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

**(11) 温州银行股份有限公司**

注册地址：温州市车站大道华海广场 1 号楼

办公地址：温州市车站大道 196 号

法定代表人：邢增福

联系人：林波

电话：0577-88990082

传真：0577-88995217

客服电话：0577-96699

公司网址：www.wzbank.cn

#### **(12) 烟台银行股份有限公司**

注册地址：烟台市芝罘区海港路 25 号

办公地址：烟台市芝罘区海港路 25 号

法定代表人：叶文君

联系人：王淑华

电话：0535-6699660

传真：0535-6699884

客服电话：4008-311-777

公司网址：www.yantaibank.net

#### **(13) 东吴证券股份有限公司**

注册地址：苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客服电话：0512-33396288

公司网址：www.dwzq.com.cn

#### **(14) 海通证券股份有限公司**

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

联系人：金芸、李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-23219100

客服电话：021-95553

公司网址：www.htsec.com

#### **(15) 中国银河证券股份有限公司**

注册地址：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：010-66568430

传真：010-66568536

客服电话：4008-888-888

公司网址：www.chinastock.com.cn

**(16) 申银万国证券股份有限公司**

注册地址：上海常熟路 171 号

办公地址：上海常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

联系人：邓寒冰

电话：021-54033888

传真：021-54038844

客服电话：021-962505

公司网址：www.sywg.com.cn

**(17) 中信建投证券股份有限公司**

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝内大街 188 号

法定代表人：张佑君

联系人：权唐

电话：(010) 65183880

传真：(010) 65182261

客服电话：400-8888-108

公司网址：www.csc108.com

**(18) 广发证券股份有限公司**

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、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

客服电话：95575 或致电各地营业网点

公司网址：www.gf.com.cn

**(19) 国信证券股份有限公司**

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 6 层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客服电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

#### **(20) 湘财证券有限责任公司**

注册地址：长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼

法定代表人：林俊波

联系人：钟康莺

电话：021-68634518

传真：021-68865680

客服电话：400-888-1551

公司网址：www.xcsc.com

#### **(21) 国联证券股份有限公司**

注册地址：无锡市县前东街 8 号 6 楼、7 楼

办公地址：无锡市县前东街 8 号 6 楼、7 楼

法定代表人：雷建辉

联系人：徐欣

电话：0510-82831662

传真：0510-82830162

客服电话：400 888 5288

公司网址：www.glsc.com.cn

#### **(22) 国泰君安证券股份有限公司**

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

联系人：吴倩

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客户服务热线：400-8888-666

#### **(23) 金元证券股份有限公司**

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层  
办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层  
法定代表人：陆涛  
联系人：马贤清  
电话：( 0755 ) 83025022  
传真：( 0755 ) 83025625  
客服电话：4008-888-228  
公司网址：www.jyzq.com.cn

**(24) 安信证券股份有限公司**

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02  
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：0755-82825551  
传真：0755-82558305  
客服电话：400-800-1001  
公司网址：www.essence.com.cn

**(25) 华泰证券股份有限公司**

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦  
办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦  
法定代表人：吴万善  
电话：025-83290523  
传真：025-84579763  
联系人：肖亦玲  
客服电话：95597  
公司网址：www.htsc.com.cn

**(26) 中航证券有限公司**

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼  
办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼  
法定代表人：杜航  
联系人：戴蕾  
电话：0791-86768681  
传真：0791-86770178  
客服电话：400-8866-567

公司网址：www.avicsec.com

**(27) 财富证券有限责任公司**

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法定代表人：周晖

联系人：郭磊

电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

客服电话：0731-84403350

公司网址：www.cfzq.com

**(28) 中信万通证券有限责任公司**

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 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

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客服电话：0532-96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

**(29) 光大证券股份有限公司**

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨、李芳芳

客服电话：4008888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

**(30) 渤海证券股份有限公司**

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客服电话：400-6515-988

公司网址：www.bhzq.com

**(31) 中银国际证券有限责任公司**

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39-40F

法定代表人：许刚

联系人：马瑾

电话：(021) 20328720

客户服务电话：4006208888

公司网址：www.bocichina.com

**(32) 招商证券股份有限公司**

注册地址：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

电话：(0755) 82943666

传真：(0755) 82943636

联系人：林生迎

客服电话：95565、400-8888-111

公司网址：www.newone.com.cn

**(33) 齐鲁证券有限公司**

注册地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

办公地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

电话：(0531) 68889155

传真：(0531) 68889752

联系人：吴阳

客服电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

**(34) 恒泰证券股份有限公司**

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区东风路 111 号

法定代表人：鞠瑾

电话：0471-4913998

传真：0471-4930707

联系人：常向东

客服电话：0471-4961259

公司网址：www.cnht.com.cn

**(35) 南京证券有限责任公司**

注册地址：江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号

办公地址：江苏省南京市玄武区大钟亭 8 号

法定代表人：张华东

联系人：水晨

电话：025-83367888

传真：025-83320066

客服电话：400-828-5888

公司网址：www.njzq.com.cn

**(36) 东海证券有限责任公司**

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

联系人：梁旭

联系电话：0519-88157761

联系传真：0519-88157761

免费服务热线：400-888-8588

公司网址：www.longone.com.cn

**(37) 中国中投证券有限责任公司**

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-8202 3442

传真：0755-8202 6539

客服热线：400 600 8008

公司网址：www.china-invs.cn

**(38) 爱建证券有限责任公司**

注册地址：上海市南京西路 758 号 23 楼  
办公地址：上海市南京西路 758 号 20-25 楼  
法定代表人：郭林  
联系人：戴莉丽  
电话：021-32229888-25122  
传真：021-62878783  
客服电话：021-63340678  
公司网址：www.ajzq.com

**(39) 天相投资顾问有限公司**

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701  
办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 4 层  
法定代表人：林义相  
联系人：林爽  
联系电话：010-66045608  
传真：010-66045521  
客服服务热线：010-66045678  
天相投顾网-网址：www.txsec.com  
天相基金网-网址：www.jjm.com.cn

**(40) 华宝证券有限责任公司**

注册地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层  
办公地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层  
法定代表人：陈林  
联系人：宋歌  
电话：021-68778081  
传真：021-68778117  
客服电话：4008209898  
公司网址：www.cnhbstock.com

**(41) 平安证券有限责任公司**

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼  
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼 (518048)  
法定代表人：杨宇翔  
联系人：郑舒丽

电话：0755 - 82400862

传真：0755 - 82433794

客服热线：4008816168

公司网址：www.PINGAN.com

#### **(42) 长江证券股份有限公司**

注册地址：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

客服电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：www.95579.com

#### **(43) 华福证券有限责任公司**

注册地址：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层至10层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

客服电话：0591 - 96326（福建省外请先拨0591）

公司网址：www.hfzq.com.cn

#### **(44) 宏源证券股份有限公司**

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号

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：010-88085219

客服电话：400-800-0562

公司网址：www.hysec.com

#### **(45) 信达证券股份有限公司**

注册地址：北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

**(46) 华安证券有限责任公司**

注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座

法定代表人：李工

联系人：甘霖

电话：0551-5161666

传真：0551-5161600

客服电话：0551-96518 或者 4008096518

公司网址：www.hazq.com

**(47) 上海证券有限责任公司**

注册地址：上海市西藏中路 336 号

办公地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：郁忠民

联系人：张瑾

电话：021-53519888-1915

传真：021-33303353

客服电话：4008918918

公司网址：www.shzq.com

**(48) 广州证券有限责任公司**

注册地址：广州市越秀区先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

办公地址：广州市越秀区先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

法定代表人：吴志明

联系人：林洁茹

电话：020-87322668

传真：020-87325036

客服电话：020-961303

公司网址：www.gzs.com.cn

**(49) 厦门证券有限公司**

注册地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

办公地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

法定代表人：傅毅辉

联系人：卢金文

电话：0592-5161642

传真：0592-5161140

客服热线：0592-5163588

公司网址：www.xmzq.com.cn

#### **(50) 中信证券股份有限公司**

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-60833722

传真：010-60833739

客服热线：95558

公司网址：www.cs.ecitic.com

#### **(51) 五矿证券有限公司**

注册地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47层

办公地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心47-49层

法定代表人：高竹

联系人：高克南

电话：0755-82545707

传真：0755-82545500

客服热线：40018-40028

公司网址：www.wkzq.com.cn

#### **(52) 天源证券经纪有限公司**

注册地址：青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼

办公地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦18楼

法定代表人：林小明

联系人：聂晗

电话：0755-33331188

传真：0755-33329815

客服热线：4006543218

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

**(53) 财富里昂证券有限责任公司**

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法定代表人：罗浩

联系人：倪丹

电话：021-38784818

传真：021-68775878

客服热线：68777877

公司网址：[www.cf-clsa.com](http://www.cf-clsa.com)

**(54) 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 5 8 8 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 5 8 8 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法定代表人：沈强

电话：0571-86078823

传真：0571-85783711

联系人：周妍

网址：[www.bigsun.com.cn](http://www.bigsun.com.cn)

客户服务电话：0571-96598

**(55) 深圳众禄基金销售有限公司**

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、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 I、J 单元

法定代表人：薛峰

联系人：张玉静

电话：0755-33227953

传真：0755-82080798

客服热线：4006-788-887

公司网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

**(56) 华鑫证券有限责任公司**

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

法定代表人：洪家新

联系人：孔泉

电话：0755-82083788

传真：0755-82083408

客服热线：021-32109999, 029-68918888

网址：www.cfsc.com.cn

**(57) 国海证券股份有限公司**

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅锋

联系人：牛孟宇

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

客服热线：95563

公司网址：www.ghzq.com.cn

**(58) 浙江同花顺基金销售有限公司**

注册地址：浙江省杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室

法定代表人：李晓涛

联系人：杨翼

电话：0571-88911818 转 8565

传真：0571—86800423

客服热线：4008-773-772

公司网址：www.5ifund.com

**(59) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司**

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人：汪静波

联系人：方成

电话：021-38600735

传真：021-38509777

客服热线：400 - 821 - 5399

公司网址：www.noah-fund.com

**(60) 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

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：潘世友

电话：021-54509998

传真：021-64385308

客服热线：400-1818-188

公司网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

**(61) 杭州数米基金销售有限公司**

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

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：张裕

电话：021-60897869

传真：0571-26698533

客服热线：4000 766 123

公司网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

**(62) 和讯信息科技有限公司**

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：周轶

电话：021-20835789

传真：021-20835885

客服热线：400-920-0022

公司网址：<http://licaike.hexun.com/>

**3. 基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。**

**(二) 注册登记机构：东吴基金管理有限公司**

注册地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

法定代表人：任少华

联系人：吴靖

电话：021-50509888

传真：021-50509884

客户服务电话：400-821-0588（免长途话费） 021 - 50509666

网站：www.scfund.com.cn

**(三) 律师事务所和经办律师**

名称：北京市君泽君律师事务所

住所：北京市西城区金融大街9号金融街中心南楼6层

办公地址：北京市西城区金融大街9号金融街中心南楼6层

负责人：陶修明

电话：010-66523388

传真：010-66523399

经办律师：王勇、余红征

**(四) 会计师事务所和经办注册会计师**

名称：江苏天衡会计师事务所有限公司

注册地址：南京市正洪街18号东宇大厦8楼

办公地址：南京市正洪街18号东宇大厦8楼

法定代表人：余瑞玉

经办注册会计师：谈建忠 魏娜

电话：025-84711188

传真：025-84716883

#### 四、基金的名称

本基金名称：东吴新产业精选股票型证券投资基金

#### 五、基金的类型

本基金类型：股票型证券投资基金

#### 六、基金的投资目标

本基金为股票型基金，主要投资于新兴产业相关上市公司，分享中国新兴产业成长的成果，追求超越市场的收益。

#### 七、基金的投资范围

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（含创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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的相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金为股票型基金，投资组合中股票类资产投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于新兴产业类上市公司股票的比例不低于股票资产的 80%，权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，固定收益类资产投资比例为基金资产的 0-35%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

#### 八、基金的投资策略

本基金依托行业研究和金融工程团队，采用“自上而下”资产配置和“自下而上”精选个股相结合的投资策略。本基金通过对宏观经济和市场走势进行研判，结合考虑相关类

别资产的收益风险特征，采用定量与定性相结合的方法动态的调整股票、债券、现金等大类资产的配置。

## 1、资产配置策略

对于大类资产的配置，本基金主要由投资研究团队根据对宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势和风险收益水平；在各大类资产投资比例限制前提下，根据大类资产风险收益分析结果，并结合本基金风险收益目标，最终确定、调整基金资产中股票、债券和现金的配置比例。

## 2、选股策略

### 1) 新兴产业类上市公司选股策略

首先按照基金投资范围构建基金初选股票池，本基金新兴产业类上市公司投资范围包括“十二五”规划公布的七大战略性新兴产业类上市公司和未列入七大战略性新兴产业范围的其它新兴产业类的上市公司；然后，本基金采用自上而下与自下而上相结合的选股策略，精选其中具有成长、估值优势和竞争优势的上市公司股票作为投资对象。

### A. 基金初选股票池构建

首先按照两大类对新兴产业类上市公司进行识别，分别为战略性七大新兴产业类上市公司和其它新兴产业类上市公司，形成新兴产业类上市公司基金初选股票池。

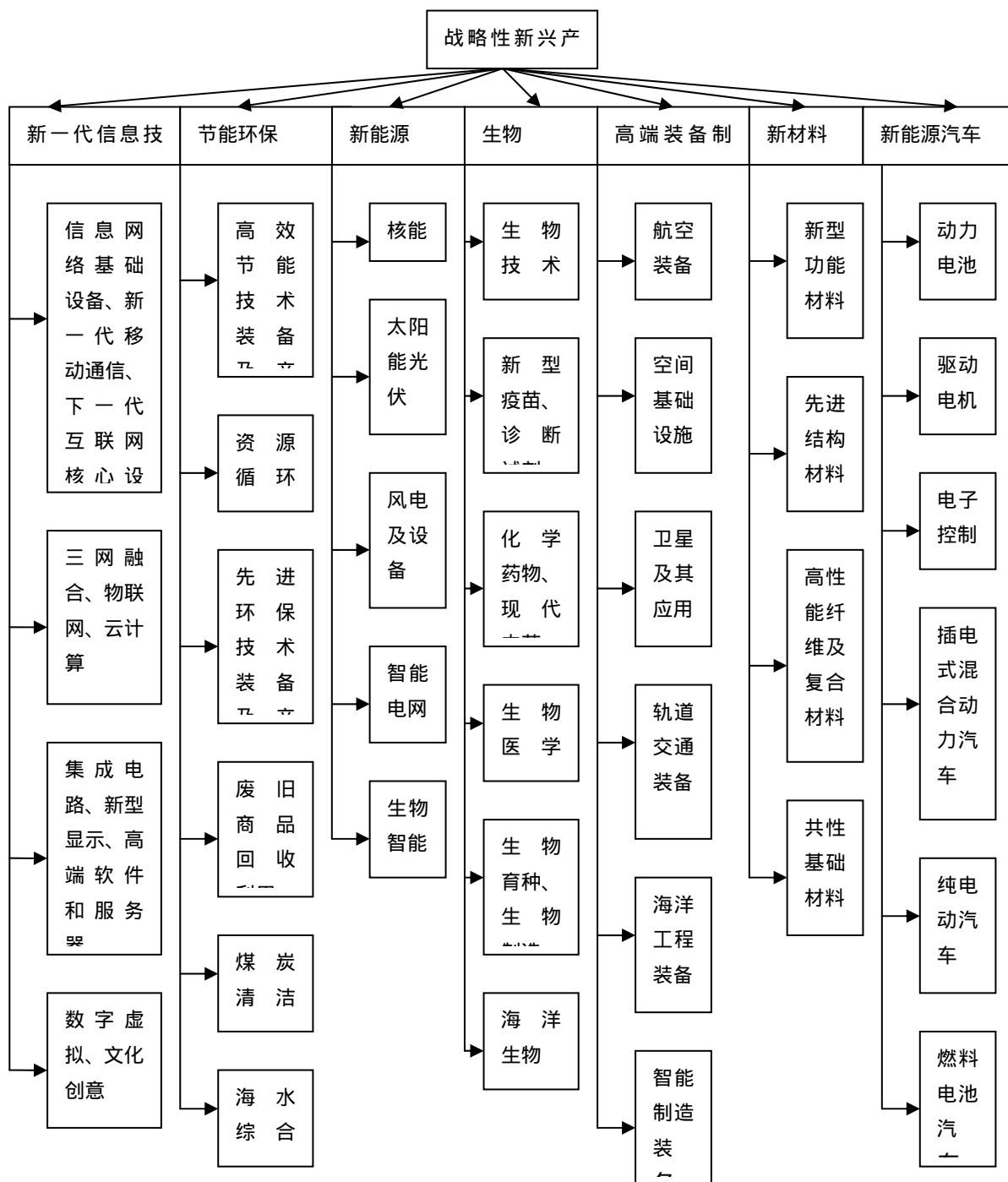
#### (1) 战略性七大新兴产业初选股票池构建

战略性新兴产业是以重大技术突破和重大发展需求为基础，对经济社会全局和长远发展具有重大引领带动作用，知识技术密集、物质资源消耗少、成长潜力大、综合效益好的产业。

根据2010年10月18日发布的《中共中央关于制定国民经济和社会发展第十二个五年规划的建议》中战略性新兴产业的排序和《决定》中对战略性新兴产业的详细说明，本基

金对战略性新兴产业及其细分进行了以下梳理，并将归属于以下细分行业的上市公司纳入新兴产业类上市公司基金初选股票池。

图 1 战略性新兴产业细分



资料来源：东吴基金

## (2) 其它新兴产业类上市公司初选股票池构建

本基金所投资的未列入战略性新兴产业范围的新产业是指，以一定的重要技术突破和重要发展需求为基础，对经济社会发展具有重要带动作用，知识技术较为密集、物质资源消耗较少、成长潜力较大、经济效益较好的产业。

新兴产业本身是一个动态更新的概念，本基金管理人将持续跟踪新科研成果、新技术、新工艺、新商业模式、新目标市场和相关政策的变化所导致的最新产业形态和相关上市公司的变化。一方面，将那些运用更先进的技术和更新商业模式等的行业纳入新兴产业的投资范围；另一方面，对于随着原有的新技术和新商业模式等的推广而发展的行业，如果仍然具有的较高发展速度和利润水平，也会被纳入到新兴产业的范围；最后，对于随着相关技术成熟，商业模式普及，行业竞争加剧，利润增速下降等而逐渐进入平稳运行期的原新兴产业相关行业，本基金将其剔除出新兴产业的投资范围。

## B. 基金备选股票池的构建

在初选股票池的基础上，本基金管理人根据成长性、价值性指标对上市公司进行进一步筛选形成基金备选股票池，再根据“东吴基金企业竞争优势评价体系”，精选出具有竞争优势的上市公司股票作为基金股票池。

### (1) 根据投资组合成长性的定量分析，形成基金备选股票池

#### 成长性定量指标

本基金通过定性和定量相结合的方法来确定描述成长性的指标，定性的方法主要是研究国内外主要投资机构选择的成长性定量指标，结合国内的实际情况进行归纳总结，在此基础上，运用单因素分析，对各因素在国内市场的效果进行分析，找出最有效的指标。以下七个指标是本基金选取的衡量上市公司成长性的指标。

表 1：成长模块衡量成长性定量指标

EG	净利润增长率
REG	预期净利润增长率
RG	营业收入增长率
ROE	净资产收益率
EROE	预期净资产收益率

ROA	资产收益率
NAV	净资产增长率

### 根据成长性综合分值，形成基金备选股票池

按照以上七个成长性定量指标，对初步基金股票池中股票组合的过去三年，共三十六个月的历史数据进行分析。搜集组合中个股过去三十六个月的成长性指标数据，取各个成长性指标的数学平均值，将各项指标按等权重加权并相加汇总，得到个股成长性综合分值。

#### 成长性综合指标(GI)=

$$EG \times W_{EG} + REG \times W_{REG} + RG \times W_{RG} + ROE \times W_{ROE} + EROE \times W_{EROE} + ROA \times W_{ROA} + NAV \times W_{NAV}$$

注： $W_{EG}$ 、 $W_{REG}$ 、 $W_{RG}$ 、 $W_{ROE}$ 、 $W_{EROE}$ 、 $W_{ROA}$ 、 $W_{NAV}$  分别代表各个指标的权重，在本基金选股时，以上七个指标的权重相等。

得到股票成长性指标(GI)分值之后，对 GI 分值进行排序，选择前 80%的股票进入下一步筛选，其余股票剔除，形成基金备选股票池。

### (2) 根据投资组合价值性的定量分析，形成基金备选股票池

在上述使用价值性指标筛选出的股票后，对这些股票进行价值评估，筛选过程的计算方法和步骤同价值性指标一样，也是分为两个部分：分别是确定描述价值的定量指标和计算股票价值分值。

#### 价值性定量指标

同成长性指标研究方法一样，本基金仍然通过定性和定量相结合的方法来确定描述价值性的指标，最终，以下五个指标是本基金选取的衡量上市公司价值的指标。

表 2：价值模块衡量股票价值定量指标

PE	市盈率
PB	市净率
PS	市销率
PCF	市现率
EV/EBITDA	企业价值倍数

### 根据价值性综合分值，形成基金备选股票池

按照以上五个价值性定量指标，对初步基金股票池中股票组合的过去三年，共三十六个月的历史数据进行分析。搜集组合中个股过去三十六个月的价值性指标数据，取各个价值性指标的数学平均值，将各项指标按等权重加权并相加汇总，得到个股价值性综合分值。

#### 价值性综合指标(VI)=

$$PE \times W_{PE} + PB \times W_{PB} + PS \times W_{PS} + PCF \times W_{PCF} + EV / EBITDA \times W_{EV / EBITDA}$$

注： $W_{PE}$ 、 $W_{PB}$ 、 $W_{PS}$ 、 $W_{PCF}$ 、 $W_{EV/EBITDA}$  分别代表各个指标的权重，在本基金选股时，以上五个指标的权重相等。

得到股票价值性指标(VI)分值之后，对VI 分值进行排序，选择前 80%的股票进入下一步筛选，其余股票剔除，形成基金备选股票池。

### (3) 东吴基金企业竞争优势评价体系

形成基金备选股票池之后，本基金将根据“东吴基金企业竞争优势评价体系”，计算备选股票池中上市公司的竞争优势综合分值，评价新兴产业上市公司的投资价值，精选出竞争优势综合分值排名靠前 50%的上市公司股票作为基金股票池。

#### 2) 非新兴产业类上市公司选股策略

非新兴产业类上市公司的可投资比例占股票资产的 20%，对于这一投资比例范围内的股票池构建适用东吴嘉禾基金的股票池。

#### 2、 股票池调整法则

原则上，本基金根据上市公司发布定期报告对股票池进行相应调整。在宏观经济环境、行业基本面和市场指数发生重大变化情况下，可进行临时调整。同时，可根据行业研究员调研情况和研究成果，综合考虑上市公司的行业趋势、公司基本面、估值水平等方面的情对本基金股票池内股票进行个别调进或调出。

### 3、 债券投资组合

本基金将根据利率变化的大周期、市场运行的小周期和中国债券市场的扩张特征，制定相应的债券投资策略，以获取利息收益为主、资本利得为辅。

#### 1) 积极的流动性管理

本基金将紧密关注央行对于流动性的调节以及市场的资金松紧，本基金的申购/赎回现金流情况、季节性资金流动、日历效应等，建立组合流动性管理框架，实现对基金资产的结构化管理，以确保基金资产的整体变现能力。

#### 2) 基于收益率预期的期限配置和类别配置

在预期基准利率下降时，适当增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，同时获得比较高的利息收入；在预期基准利率上升时，缩短组合久期，以规避债券价格下降的风险。

#### 3) 基于收益率曲线变形的调整策略

在确定组合久期的情况下，预期收益曲线的变形调整债券组合的基本配置。当我们预期收益率曲线变陡时，我们将可能采用子弹策略；而当预期收益率曲线变平时，我们将可能采用杠铃策略，总体而言，就是在仔细评估收益曲线变形情况下，分别在子弹组合、梯式组合和杠铃组合中弹性选择。

#### 4) 基于相对利差分析调整信用产品配置

观察金融债/国债，短期融资券/央票的相对利差调整组合的信用产品，在稳定的信用产品风险情况下，可在利差扩大时，适当增加信用产品比重；在利差缩小时，适当减持信用产品。

#### 4、 权证投资策略

本基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。具体投资方法如下：

考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素，估计权证合理价值。

根据权证合理价值与其市场价格间的差幅以及权证合理价值对定价参数的敏感性，结合标的股票合理价值考量，决策买入、持有或沽出权证。

## 九、 业绩比较基准

基金业绩比较基准= 75%\*中证新兴产业指数 + 25%\*中国债券综合全价指数

本基金股票投资比例为 60%-95%，债券投资比例为 0-35%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，根据相关法律法规定义，本基金为股票型基金。因此，本基金总体业绩比较基准中，股票资产业绩比较基准给予了 75%的权重，而债券资产业绩比较基准给予了 25%的权重。本基金选择中证新兴产业指数作为股票资产业绩比较基准，中证新兴产业指数由中证指数公司正式发布，是目前市场上唯一一支以新兴产业为主题并横跨跨沪深两市的指数，并且该指数采用等权重方式加权计算，综合反映沪深市场中新兴科技和新兴产业深度融合的战略性新兴产业在证券市场的发展变化。因此，本基金股票资产业绩比较基准选择中证新兴产业指数。

## 十、风险收益特征

本基金是一只进行主动投资的股票型基金，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益也较高的基金产品。

## 十一、基金投资组合报告

东吴新产业精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)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。

本基金的托管人中国建设银行根据本基金合同规定,于2013年08月26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。

### 1、截至2013年06月30日基金资产组合情况：

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	46,136,566.47	83.83
	其中：股票	46,136,566.47	83.83
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	7,010,217.03	12.74
6	其他各项资产	1,886,161.23	3.43
7	合计	55,032,944.73	100.00

### 3、截至2013年06月30日按行业分类的股票投资组合：

金额单位：人民币元

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	-	-
C	制造业	37,641,753.67	70.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供	-	-

	应业		
E	建筑业	1,488,600.00	2.80
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	信息传输、软件和信息技术服务业	2,599,612.80	4.89
J	金融业	2,949,800.00	5.55
K	房地产业	1,456,800.00	2.74
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	46,136,566.47	86.78

### 3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1) 截至 2013 年 06 月 30 日按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细：  
金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600867	通化东宝	228,000	3,394,920.00	6.39
2	600352	浙江龙盛	279,894	2,625,405.72	4.94
3	002063	远光软件	179,904	2,599,612.80	4.89
4	002415	海康威视	70,617	2,495,604.78	4.69
5	600276	恒瑞医药	86,000	2,266,960.00	4.26
6	600261	阳光照明	177,608	2,252,069.44	4.24
7	002241	歌尔声学	60,000	2,177,400.00	4.10
8	002005	德豪润达	210,000	1,953,000.00	3.67
9	600837	海通证券	200,000	1,876,000.00	3.53
10	000625	长安汽车	200,000	1,858,000.00	3.49

### 4、截至 2013 年 06 月 30 日，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、截至 2013 年 06 月 30 日，按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资  
 明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、截至 2013 年 06 月 30 日，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。

7、截至 2013 年 06 月 30 日，按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证  
 投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

(1) 本报告期内，本基金本期投资的前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查  
 的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

(2) 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。

(3) 截至 2013 年 06 月 30 日，其他各项资产构成：

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	69,411.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,723.86
5	应收申购款	1,815,025.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,886,161.23

(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。

(5) 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十二、基金的业绩

本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,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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

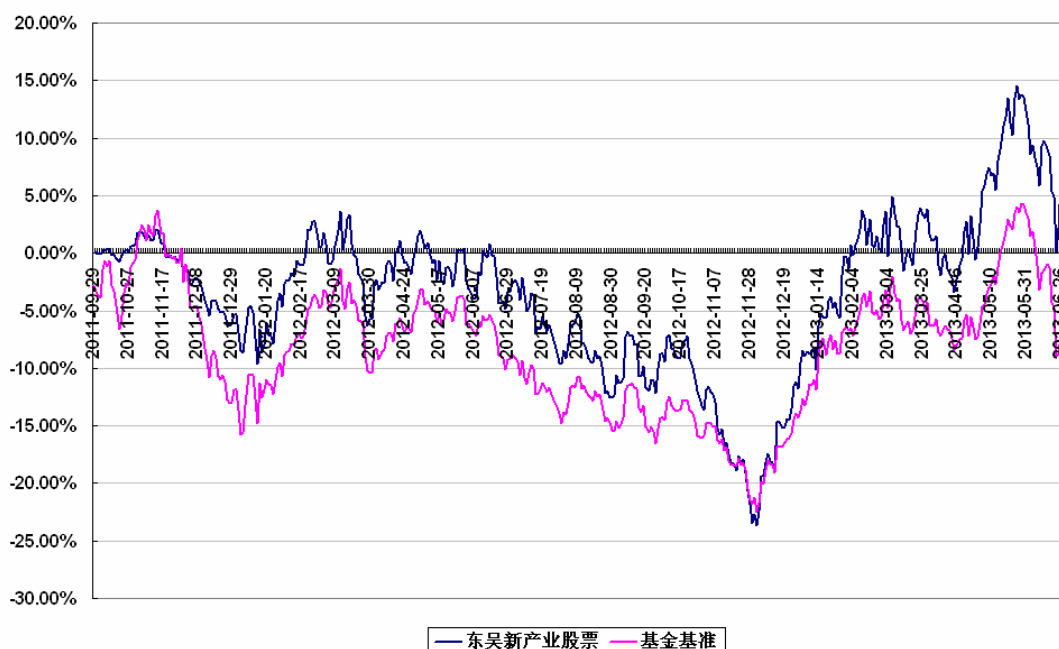
### (1) 东吴新产业精选基金历史时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

时间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
2011.09.28-2011.12.31	-5.30%	0.56%	-10.99%	1.24%	5.69%	-0.68%
2012.01.01-2012.12.31	-3.38%	1.32%	-0.96%	1.11%	-2.42%	0.21%
2011.09.28-2012.12.31	-8.50%	1.21%	-12.65%	1.14%	4.15%	0.07%
2013.01.01-2013.06.30	13.99%	1.64%	4.68%	1.20%	9.31%	0.44%
2011.09.28-2013.06.30	4.30%	1.34%	-8.77%	1.16%	13.07%	0.18%

注:基金业绩比较基准=75%\*中证新兴产业指数 + 25%\*中国债券综合全价指数,数据截止到2012年12月31日。

### (2) 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩基准收益率的比较图

(2011年09月28日至2013年06月30日)



注:东吴新产业精选基金于2011年9月28日成立。

### 十三、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### 1. 基金转换业务的适用范围

截至 2013 年 9 月 28 日，本基金已开通与本基金管理人旗下基金：东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金（基金代码：580001）、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金（基金代码：580002）、东吴行业轮动股票型证券投资基金（基金代码：580003）、东吴优信稳健债券型证券投资基金 A（基金代码：582001）、东吴优信稳健债券型证券投资基金 C（基金代码：582201）、东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：580005）、东吴新经济股票型证券投资基金（基金代码：580006）、东吴货币市场证券投资基金 A（基金代码：583001）和东吴货币市场证券投资基金 B（基金代码：583101）、东吴中证新兴产业指数证券投资基金（基金代码：585001）、东吴增利债券型证券投资基金 A（基金代码：582002）、东吴增利债券型证券投资基金 C（基金代码：582202）、东吴新创业股票型证券投资基金（基金代码：580007）、东吴保本混合型证券投资基金（基金代码：582003）、东吴内需增长混合型证券投资基金（基金代码：580009）的基金转换业务。

基金管理人今后发行的开放式基金将根据具体情况确定是否适用于基金转换业务，并将另行公告。

#### 2. 开通转换的销售机构

投资者可通过基金管理人的直销渠道和以下代销机构办理以上基金的基金转换业务：中信银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行有限责任公司、温州银行股份有限公司、烟台银行股份有限公司、东吴证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、金元证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中航证券有限公司、财富证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、齐

鲁证券有限公司、恒泰证券股份有限公司、南京证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、华宝证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、厦门证券有限公司、中信证券股份有限公司、天源证券经纪有限公司、财富里昂证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司、深圳众禄基金销售有限公司、华鑫证券有限责任公司、国海证券股份有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、上海天天基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司。

根据业务需要，本基金管理人还将会选择其他销售机构开办此业务并将按有关规定予以公告。

## 十四、基金费用与税收

### （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. 基金财产划拨支付的银行费用；
4. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
7. 基金的证券交易费用；
8. 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### （三）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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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，经基金托管人复核后于次月首日起 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、休息日，支付日期顺延。

## 2. 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3. 除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

## (四) 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财产的损失，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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

**(五) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。**基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

## (六) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 十五、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》、《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》及其它有关法律法规的要求,本基金管理人对本基金原招募说明书进行了更新,并根据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要更新的内容如下:

- 1、在“重要提示”中,对相关内容进行了更新。
- 2、在“三、基金管理人”中,对相关内容进行了更新。
- 3、在“四、基金托管人”中,对相关内容进行了更新。
- 4、在“五、相关服务机构”中,对相关内容进行了更新。
- 5、在“八、基金份额的申购与赎回”中,对相关内容进行了更新。
- 6、在“九、基金的投资”中,对相关内容进行了更新。
- 7、在“十、基金的业绩”中,对相关内容进行了更新。
- 8、在“二十、基金托管协议的内容摘要”中,对相关内容进行了更新。
- 9、在“二十二、其他应披露事项”中,对相关内容进行了更新:

(1) 2013年03月29日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》;

(2) 2013年03月30日证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于赎回固有资金所投资旗下部分基金的公告》;

(3) 2013年04月13日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》;

(4) 2013年04月17日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》;

(5) 2013年04月22日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司东吴新产业精选股票型证券投资基金2013年第一季度报告》;

(6) 2013年04月25日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》;

(7) 2013年05月11日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司东吴新产业精选股票型证券投资基金更新招募说明书摘要》;

(8) 2013年05月29日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》;

(9) 2013年06月05日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司东吴新产业精选股票型证券投资基金基金经理变更公告》；

(10) 2013年06月15日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

(11) 2013年06月26日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

(12) 2013年06月27日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

(13) 2013年07月02日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于在交通银行股份有限公司网上银行、手机银行延长基金申购费率优惠的公告》；

(14) 2013年07月11日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于新增杭州数米基金销售有限公司为代销机构并推出定期业务及转换业务的公告》；《东吴基金管理有限公司关于在杭州数米基金销售有限公司申购费率及定投申购费率优惠的公告》；《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参与杭州数米基金销售有限公司和上海天天基金销售有限公司基金转换申购补差费率优惠活动的公告》；

(15) 2013年07月18日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司东吴新产业精选股票型证券投资基金2013年第二季度报告》；

(16) 2013年08月15日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》；

(17) 2013年08月20日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司网上申购、定期定额费率优惠的公告》；

(18) 2013年08月29日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司东吴新产业精选股票型证券投资基金2013年半年度报告摘要》；

(19) 2013年08月29日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司东吴新产业精选股票型证券投资基金2013年半年度报告》；

(20) 2013年09月10日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于在和讯信息科技有限公司申购费率及定投申购费率优惠的公告》；

(21)2013年09月10日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于新增和讯信息科技有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告》。

## 十六、签署日期

本基金更新招募说明书于2013年11月11日签署。

东吴基金管理有限公司  
二零一三年十一月十一日