东吴行业轮动股票型证券投资基金更新招募说明书摘要

东吴行业轮动股票型证券投资基金基金合同于2008年4月23日经中国证监会书面确认，基金备案手续办理完毕，基金合同自该日起正式生效。

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

重要提示

本基金根据2008年2月22日中国证券监督管理委员会《关于核准东吴行业轮动股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可［2008］296号）的核准，进行募集。

基金管理人保证《东吴行业轮动股票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。

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，投资人认购或申购基金时应认真阅读招募说明书。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，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，包括：因政治、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，个别证券持有的非系统性风险，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，本基金的特定风险，基金运作风险，此外，本基金以1元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在单位份额净值跌破1元初始面值的风险。等等。

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》。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资者有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资者投资于本基金时应认真阅读本《招募说明书》。全面认识本基金产品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，理性判断市场，对认购基金的意愿、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的"买者自负"原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2011年4月23日，有关财务数据和净值表现截止日为2010年3月31日（财务数据未经审计）。

本《招募说明书》依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称"《基金法》"）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称"《运作办法》"）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称"《销售办法》"）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称"《信息披露办法》"）、其他有关规定及《东吴行业轮动股票型证券投资基金基金合同》（以下简称"《基金合同》"或"基金合同"）编写。

本招募说明书根据基金合同编写，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。投资者取得依基金合同所发售的基金份额，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；基金投资者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。

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：徐建平

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［2004］132号

7.组织形式：有限责任公司

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：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
东吴证券有限责任公司	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.高管情况介绍：

东吴基金管理有限公司下设投资管理部、研究策划部、国际业务部、产品策略部、市场营销部、机构理财部、基金事务部、信息技术部、综合管理部和监察稽核部等10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。

（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、苏州市税务局副科长、苏州市税务局三分局副长、苏州市税务局科长、苏州市审计局副局长。现任东吴证券有限责任公司董事长、总裁，中共东吴证券有限责任公司党委书记。

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、投资管理部总经理。

徐建平先生，董事，硕士研究生，会计师，中共党员。历任张家港市财政局科长兼市房改办副主任，东吴证券有限责任公司张家港杨舍证券营业部总？经理、公司总裁助理兼资产管理总部总经理，东吴证券有限责任公司副总裁。现任东吴基金管理有限公司总经理。

陆安伟先生，董事，研究生，经济师，中共党员。历任江苏省计划经济委员会副科长、江苏省国际信托投资公司证券部经理，信泰证券有限公司董事、常务副总裁。现任江苏澄星实业集团有限公司常务副总裁。

王金米先生，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，东吴证券有限责任公司投行总部副总经理。现任东吴证券有限责任公司董事长助理。

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。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、金融系主任。

张平先生，独立董事，博士，研究员。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、研究员，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。现任光大证券有限责任公司独立董事。

2.监事会成员

石震亚先生，监事长，大学，会计师。历任苏州市审计局科员、副主任科员，苏州证券有限责任公司财务部总经理，东吴证券有限责任公司财务总监。现任东吴证券有限责任公司副总裁，中共东吴证券有限责任公司党委纪委书记、党委委员。

赵江先生，监事，大专，会计师。历任中国船舶工业集团公司澄西船厂财务处会计科长，现任江苏澄星磷化工股份有限公司财务总监。

王桐女士，员工监事，硕士学历。历任大鹏证券研究所和投资咨询研究员、首席分析师助理、东吴基金管理有限公司基金经理助理等职，现任东吴基金管理有限公司投资总监，兼任投资管理部总经理、东吴价值成长双动力基金基金经理、东吴进取策略灵活配置基金基金经理。

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）

徐建平先生，总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

胡玉杰女士，副总经理，经济学硕士，历任大鹏证券有限责任公司营业部总经理、融资服务公司董事、副总经理；2004年9月任东吴基金管理有限公司市场总监；现任东吴基金管理有限公司副总经理。

吴威先生，督察长，经济学博士，历任兴业证券股份有限公司研究发展中心、高级研究员、国际业务部负责人、兴业基金管理有限公司筹备组成员、兴业基金管理有限公司副总经理，日本野村证券北京代表处业务拓展总监。现任东吴基金管理有限公司督察长。

4.基金经理

任红先生，管理学博士，中共党员，中国社科院金融所博士后，副研究员，具有17年证券从业经验。曾任兴业证券研发中心金融、房地产行业高级研究员，东吴基金公司基金经理助理。现任东吴行业轮动基金、新经济基金基金经理。

5.投资决策委员会成员

徐建平　总经理；

王　炯　总裁助理、投资总监，兼投资管理部总经理、基金经理；

黎　瑛　研究副总监、研究策划部总经理；

陈　宪　首席策略规划师。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

一、基金托管人概况

1、基本情况

名称：华夏银行股份有限公司

住所：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

电话：010-85238667

传真：010-85238680

联系人：刘鹏

成立时间：1992年10月14日

组织形式：股份有限公司

注册资本：4,990,528,316元人民币

批准设立机关和设立文号：中国人民银行《银复［1992］391号］

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字［2005］25号

存续期间：持续经营

2、主要人员情况

华夏银行资产托管部内设市场综合室、交易管理室、风险管理室和销售管理室等4个职能处室，并在上海、深圳分行设立2个托管分部。资产托管部共有员工31人，高管人员拥有硕士以上学位或高级职称。

3、基金托管业务经营情况

华夏银行于2005年2月23日经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准，获得证券投资基金托管资格，是《证券投资基金法》和《证券投资基金托管资格管理办法》实施后取得证券投资基金托管资格的第一家银行。自成立以来，华夏银行资产托管部本着"诚实信用、勤勉尽责"的行业精神，始终遵循"安全保管资金资产，提供优质托管服务"的原则，坚持以客户为中心的服务理念，依托严格的内控管理、先进的技术系统、优秀的业务团队、丰富的业务经验，严格履行法律和托管协议所规定的各项义务，为广大基金份额持有人和资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至2011年3月末，已托管长城货币市场基金、国联安德盛精选股票基金、广发货币市场基金、诺安优化收益债券型基金、益民红利成长混合型基金、东吴行业轮动股票基金、申万菱信稳益宝债券型证券投资基金及其它受托资产产品，托管各类资产规模147.54亿元。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：

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：徐建平

联系人：吴靖

直销电话：021-50509880

传真：021-50509884

客户服务电话：021-50509666

网站：www.scfund.com.cn

2、代销机构：

①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

网站：www.hxb.com.cn

②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：郭树清

联系人：张静

电话：010-67596084

传真：010-66218888

客服电话：95533

网站：www.ccb.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：项俊波

联系人：腾涛

电话：010-68424199

传真：010-68424181

客服电话：95599

网站：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：田静

电话：010-66106912

传真：010-66016904

客服电话：95588

网站：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：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：曹彤

客服电话：95559

网站：www.bankcomm.com

⑥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

法定代表人：孔丹

联系人：金雷

电话：010-65557013

传真：010-65550827

客服电话：95558

网站：http://bank.ecitic.com

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：秦晓

联系人：邓小鹏

电话：0755-83198888

传真：0755-83195049

客服电话：95555

网站：www.cmbchina.com

⑧深圳发展银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人：法兰克纽曼（Frank Neil Newman）

联系人：张菁

电话：0755-22166118

传真：0755-25841098

客服电话：95501

网站：www.sdb.com.cn

⑨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：董云巍

电话：010-58351666

传真：010-83914283

客服电话：95568

网站：www.cmbc.com.cn

⑩中国邮政储蓄银行有限责任公司

注册地址：北京市西城区宣武门西大街131号

办公地址：北京市西城区宣武门西大街131号

法定代表人：刘安东

客户服务电话：95580

联系人：陈春林

传真：010-66415194

网站：www.psbc.com

⑪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：宁波市江东区中山东路294号

法定代表人：陆华裕

联系人：胡姣励

电话：021-63586210

传真：021-63586215

客服电话：96528，上海地区962528

网站：www.nbcb.com.cn

⑫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

电话：0755-22197874

传真：0755-22197701

联系人：蔡宇洲

客户服务电话：40066-99999（免长途费）0755-961202

网站：www.pingan.com

⑬温州银行股份有限公司

注册地址：温州市东站大道华海广场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

客户服务电话：0577-96699

银行网站：www.wzbank.cn

⑭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：庄永辉

联系人：姚华

电话：0535-6691337

传真：0535-6680900

客户服务热线：4008-311-777

公司网址：www.yantaibank.net

⑮东吴证券有限责任公司

注册地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层

法定代表人：吴永敏

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

客户服务电话：0512-33396288

网站：www.dwzq.com.cn

⑯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

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：金芸、李笑鸣

客服电话：021-95553

网站：www.htsec.com

⑰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：顾伟国

电话：010-66568047

传真：010-66568116

联系人：李洋

客服电话：4008-888-888

网站：www.chinastock.com.cn

⑱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

电话：021-54033888

传真：021-54038844

联系人：邓雪冰

客服电话：021-962505

网站：www.sw2000.com.cn

⑲中信建投证券有限责任公司

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

客服电话：400-8888-108

网站：www.csc108.com

⑳广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市天河北路183号大都会广场43楼

办公地址：广东省广州市天河北路183号大都会广场18、19、36、38、41和42楼

法定代表人：王志伟

电话：020-87555888

传真：020-87555417

联系人：沈东旻、黄岚

客户服务热线：95575

网站：www.gf.com.cn

㉑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：025-84457777-721

传真：025-84579879

联系人：樊昊

客户服务电话：025-84579897

网站：www.htsc.com.cn

㉒兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路99号标力大厦

办公地址：浦东新区民生路1199弄证大·五道口广场1号楼21层

法定代表人：兰荣

电话：021-38565785

传真：021-68419867

联系人：杨盛芳、谢高得

客服电话：400-8888-123

网站：www.xyzq.com

㉓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16-26层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

联系人：齐晓燕

客服电话：95536

网站：www.guosen.com.cn

㉔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：上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能大厦

法定代表人：陈学荣

电话：021-68634518

传真：021-68865938

联系人：钟瑾莺

客服电话：400-888-1551

网站：www.xcsc.com

㉕长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

电话：0755-83516289

传真：0755-83516199

联系人：匡婷

客户服务热线：0755-33680000、400-6666-888

网站：www.cgws.com

㉖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

电话：0510-82831662

传真：0510-82833321

联系人：徐欣

客服电话：0510-82588168

网站：www.glsc.com.cn

㉗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：祝幼一

电话：021-62580818-213

传真：021-62674109

联系人：张婷

客服电话：400-8888-666

网站：www.gtja.com.

㉘世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42层

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42层

法定代表人：卢长才

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

联系人：刘军辉

客服电话：0755-83199511

网站：www.csco.com.cn

㉙华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

法定代表人：马晓明

电话：0755-82492000

联系人：盛淳凌

客服电话：400-8888-555

网站：www.lhzq.com

㉚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

电话：0755-83025022

传真：0755-83025625

联系人：金春

客服电话：4008-888-228

网站：www.jyzq.com.cn

㉛东方证券有限责任公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼21层-29层

法定代表人：王益民

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客户服务热线：021-962506

网站：www.dfzq.com.cn

㉜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：余江、陈剑虹

电话：0755-82558305

传真：0755-82558355

客户服务热线：400-800-1001

网站：www.essence.com.cn

㉝中航证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路291号

办公地址：江西省南昌市抚河北路291号

法定代表人：杜航

联系人：余雅娜

电话：0791-6768763

传真：0791-6789414

客户服务热线：400-8866-567

网站：http://www.avicsec.com/

㉞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：郭晋

电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

客户服务热线：0731-84403350

网站：www.cfzq.com

㉟中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路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28号

法定代表人：史浩民

电话：0532-85022026

传真：0532-85022026

联系人：吴忠超

客服电话：0532-96577

网站：www.zwt.com.cn

㊱光大证券股份有限公司

注册地址：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

法定代表人：徐浩明

电话：021-22169999@传真：021-22169134

联系人：刘晨

客服电话：4008888788、10108998

网站：www.ebscn.com

㊲渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市开发区第一大街29号

办公地址：天津市河西区宾水道3号

法定代表人：张志军

电话：022-28451861

传真：022-28451616

联系人：王兆权

客户服务电话：400-651-5988

公司网站：www.bhzq.com

㊳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：唐新宇

电话：021-68604866

传真：021-50372474

联系人：张静

客户服务电话：021-68604866

网站：www.bocichina.com

㊴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：黄健

客服电话：95565、400-8888-111

网站：www.newone.com.cn

㊵齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路128号

办公地址：山东省济南市经十路128号

法定代表人：李玮

电话：0531-81283728

传真：0531-81283735

联系人：吴阳

客服电话：95538

网站：www.qlzq.com.cn

㊶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新华东街111号

法定代表人：刘汝军

电话：0471-4913998

传真：0471-4930707

联系人：常向东

客服电话：0471-4961259

网站：www.cnht.com.cn

㊷国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路179号

办公地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志

电话：0551-2207936

传真：0551-2207965

联系人：程维

客服电话：95578

网站：www.gyzq.com.cn

㊸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

电话：025-83364032

传真：025-83320066

联系人：永晶

客服电话：400-828-5888

网站：www.njzq.com.cn

㊹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：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼

法定代表人：朱科敏

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

联系人：李涛

客户服务热线：021-52574550　0519-88166222　0379-64902266

免费服务热线：400-888-8588

网站：www.longone.com.cn

㊺中国建银投资证券有限责任公司

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层至20层

办公地址：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层至20层

法定代表人：杨明辉

电话：0755-82026511

传真：0755-82026539

联系人：杨瑞芳

客户服务热线：400-600-8008

网站：www.cjis.cn

㊻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：陈敏

电话：021-32229888

传真：021-62878783

客户服务热线：021-63340678

网站：www.ajzq.com

㊼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：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层

法定代表人：林义相

联系人：林翔

电话：010-66045529

传真：010-66045500

网站：www.txsec.com

㊽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：陈康菲

电话：021-50122222

传真：021-50122200

客户服务热线：4008209898

网站：www.cnhbstock.com

㊾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：周璐

电话：4008866338

传真：0755-82433794

客服热线：4008816168

网站：www.PINGAN.com

㊿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

客户服务热线：4008-888-999或027-85808318

网站：www.95579.com

51广发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、8、10层

邮政编码：350003

法定代表人：黄金琳

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

网站：www.gdhfzq.com.cn

52宏源证券股份有限公司（简称宏源证券）

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：010-88085344

客户服务热线：400-800-0562

网站：www.hysec.com

53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：北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

电话：010-88656100

传真：010-88656290

客服电话：400-800-8899

网站：www.cindasc.com

54开源证券有限责任公司

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

客户服务热线：0551-96518或者4008096518

网址：www.hazq.com

55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

客户服务热线：4008918918

网址：www.shzq.com

56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

客户服务热线：020-961303

公司网址：www.gzs.com.cn

57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

（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：徐建平

联系人：吴靖

电话：021-50509888

传真：021-50509884

客户服务电话：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：北京东城区东四十条68号平安发展大厦3层

办公地址：北京东城区东四十条68号平安发展大厦3层

负责人：陶修明

电话：010-84085338

传真：010-84085858

经办律师：陈冲冲、余红征

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：江苏公证会计师事务所有限公司

注册地址：无锡市新区开发区旺庄路生活区

办公地址：中国苏州新市路130号宏基大厦五楼

法定代表人：张彩斌

经办注册会计师：叶水林　吕卫星

电话：0512-65260880

传真：0512-65186030

四、与基金管理人管理的其他基金转换

（一）基金转换业务的适用范围

本基金于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前端收费（基金代码：580002）、东吴优信稳健债券型证券投资基金A类（基金代码：582001）、东吴优信稳健债券型证券投资基金C类（基金代码：582201）、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金（基金代码：580005）、东吴新经济股票型证券投资基金（基金代码：580006）、东吴新创业股票型证券投资基金（基金代码：580007）、东吴货币市场证券投资基金A级（基金代码：583001）、东吴货币市场证券投资基金B级（基金代码：583101）的基金转换业务。

（二）适用销售机构

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：

华夏银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行有限责任公司、中国农业银行股份有限公司、招行银行股份有限公司、深圳发展银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、东吴证券有限责任公司、中银万国证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、渤海证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、江阴证券有限责任公司、联合证券有限责任公司、齐鲁证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、国联证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、恒泰证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、温州银行股份有限公司、长江证券股份有限公司、广发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、上海证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、南京证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、华安证券有限责任公司、财富证券有限公司、华宝证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、厦门证券有限责任公司、招商银行股份有限公司。

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

五、基金的名称

本基金名称：东吴行业轮动股票型证券投资基金

六、基金的类型

本基金类型：契约型开放式股票型基金

七、基金的投资目标

本基金为股票型基金，通过对行业轮动规律的把握，侧重投资于预期收益较高的行业，并重点投资具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。

八、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，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证、以及法律法规或经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的60%-95%，债券投资比例为基金资产的0-35%，权证投资比例不高于基金资产净值的3%，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%。

本基金根据行业轮动规律，80%以上的非现金基金资产投资于具有"三重优势"的股票、债券、权证等资产。

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

九、基金的投资策略

本基金采取自上而下策略，根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，确定基金资产在股票、衍生产品、债券和现金上的配置比例。采取行业轮动策略，对股票资产在不同行业之间进行适时的行业轮动，动态增大预期收益率较高的行业配置，减少预期收益率较低的行业配置。对于股票投资策略，重点投资具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。

1、行业配置策略

本基金行业配置策略是通过东吴行业轮动识别模型实现的，东吴行业轮动识别模型从行业利润增长趋势和行业动态估值水平两个维度构建。以A股整体估值水平和A股整体利润增长率作为基准，同时结合国际估值的比较，将《东吴基金管理公司行业分类》中所有行业分成四类：

- A类行业：行业利润增长速度高（大于A股整体利润增长率，但必须大于0）、甚至加速增长，并且估值水平低；
- B类行业：行业利润增长速度高、甚至加速增长，但估值水平高；
- C类行业：行业利润增长速度低、甚至负增长，但估值水平低；
- D类行业：行业利润增长速度低、甚至负增长，并且估值水平高。

从行业投资价值看，从高到低依次排序为：A类行业最值得关注，其次是B类行业，然后是C类行业，D类行业投资风险最大。

本基金通过行业轮动识别模型把握行业轮动路径，评估各行业的风险收益水平，并确定投票资产在各行业之间的配置，具体配置原则是：1对于行业利润增长速度高、甚至加速增长、并且估值水平低的A区行业，配置比例高，最高可达股票资产的100%；2对于行业利润增长速度高、甚至加速增长，但估值水平高的B区行业，配置比例较高，但最高不超过股票资产的60%；3对于行业利润增长速度低，但增长速度呈现加速迹象，并且估值水平低的C区行业，配置比例较高，但最高不超过股票资产的40%；4对于行业利润增长速度低、甚至负增长，并且估值水平高的D区行业，原则上不予配置，只重点关注个股。

另外本基金将通过以下两个层面控制行业轮动判断失误带来的投资风险：1本基金将定期对行业轮动规律进行分析和识别，降低行业轮动判断失误带来的投资风险，具体做法是：每个季度，本基金将重新评估行业利润增长趋势和行业估值水平，并对行业轮动进行重新分类和调整。基金经理根据对各行业分配比例进行适当调整，从而降低行业波动风险。如果经济环境、行业基本面、或市场指数发生重大变化情况下，本基金对行业类型划分可进行临时调整。2本基金通过对行业资产配置比例的限制，避免行业过度集中带来投资风险，降低行业轮动判断失误带来的投资风险。具体原则是：本基金持有一个行业的总资产不超过基金资产净值的30%，或者不超过该行业流通市值占A股流通市值的2倍。

2、选股策略

本基金，首先从公司利润增长和股票估值水平两个维度，精选出持续增长，并且具有估值优势的股票作为初选股票池。在此基础上，本基金根据东吴企业竞争优势评价体系，选出具有竞争优势的股票作为本基金的股票池。本基金股票投资组合具体构建程序如下：

1根据东吴企业成长、估值优势识别模型构建初选股票池

东吴企业成长、估值优势识别模型是基于上市公司利润增长和股票动态估值水平两个维度构建的。具体做法是：采用数学中几何矢量图的方法，将股票估值指标和公司利润增长率分别作为几何矢量图的横坐标和纵坐标，并以A股整体估值水平和A股整体利润增长率作为基准，同时结合国际估值的比较，将所有股票分成四类：

- A类股票：利润增长速度高、甚至加速增长，并且估值水平低；
- B类股票：利润增长速度高、甚至加速增长，但估值水平高；
- C类股票：利润增长速度低、甚至负增长，但估值水平低；
- D类股票：利润增长速度低、甚至负增长，并且估值水平高。

本基金选择A类股票、B类股票，以及C类股票中利润