东吴新创业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：中国工商银行股份有限公司

重要提示

本基金根据2010年5月4日中国证券监督管理委员会《关于同意东吴新创业股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2010】【568】号）的核准，进行募集，本基金的基金合同于2010年6月29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，投资者投资于本基金时应认真阅读本《招募说明书》。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2011年6月30日，有关财务数据和净值表现截止日为2011年6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：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 （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：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、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。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，与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，与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。

陆宏伟先生，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

马震亚先生，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。

王炯女士，员工监事，硕士学历。历任大鹏证券研究所和投资部研究员、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总裁助理、投资总监，兼任投资管理部总经理。

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）

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职务；2008年7月起至今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

为加强基金管理，保护基金份额持有人的利益，本基金已于2010年9月16日增聘王少成先生担任东吴新创业股票型证券投资基金基金经理，与吴圣涛先生共同管理东吴新创业股票型证券投资基金。上述事项已按规定向中国证券业协会办理相应手续，并已报中国证监会上海证监局备案。

吴圣涛先生，9年证券从业经历。武汉大学毕业，经济学硕士，曾担任汉唐证券有限责任公司研究员、投资经理，国泰人寿保险有限责任公司投资经理，华富基金管理有限公司基金经理等职。现为东吴新经济基金、东吴新创业基金基金经理。

王少成先生，8年的证券从业经历，复旦大学硕士毕业。历任上海融昌资产管理公司研究员、中原证券自营部投资经理、信诚基金研究员和研究总监助理、东吴基金基金经理助理等职。现为东吴新创业、东吴中证新兴产业指数及东吴价值成长双动力基金基金经理。

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）基金托管人情况

1.基本情况

名称：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
成立时间：1984年1月1日
法定代表人：姜建清
注册资本：人民币349,018,545,827元
联系电话：010-66105799
联系人：赵会军

（二）主要人员情况

截至2011年6月末，中国工商银行资产托管部共有员工145人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用，勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2011年6月，中国工商银行共托管证券投资基金219只，其中封闭式7只，开放式212只。自2003 年以来，本行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的26项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

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)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：刘业伟
传真：（010）66016914
客服电话：95588
公司网址：www.icbc.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
传真：（010）66275654
客服电话：95533
公司网址：www.ccb.com

(3)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：丰靖
电话：010-65557013
传真：010-65550827
客服电话：95558
公司网址：http://bank.ecitic.com

(4)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：滕涛
电话：（010）85108227
传真：（010）85109219
客服电话：95599
公司网址：www.abchina.com

(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
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

(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：张青
电话：0755-22166118
传真：0755-25841098
客服电话：95501
公司网址：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
公司网址：www.cmbc.com.cn

(10)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

(11)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
联系人：陈春林
传真：010-66415194
客服电话：95580
公司网址：www.psbc.com

(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
联系人：蔡宇洲
电话：0755-22197874
传真：0755-22197701
客服电话：40066-99999（免长途费）0755-961202
公司网址：www.pingan.com

(13)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

(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
客服电话：4008-311-777
公司网址：www.yantaibank.net

(15)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
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

(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
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

(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
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

(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
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

(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
公司网址：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
联系人：黄岚
电话：020-87555888
传真：020-87555305
客服电话：95575
公司网址：www.gf.com.cn

(21)兴业证券股份有限公司
注册地址：福建省福州市湖东路268号证券大厦
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
联系人：谢高得
电话：021-38565785
传真：021-38565955
客服电话：400-8888-123
公司网址：www.xyzq.com

(22)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
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

(23)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

(24)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
联系人：高峰
电话：0755-83516094
传真：0755-83515567
客服电话：0755-33680000、400-6666-888
公司网址：www.cgws.com

(25)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

(26)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：芮敏祺
电话：（021）38676666
传真：（021）38670666
客服电话：400-8888-666
公司网址：www.gtja.com.

(27)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
联系人：王佳佳
电话：0755-83199599
传真：0755-83199545
客服电话：0755-83199511
公司网址：www.csco.com.cn

(28)华泰联合证券有限责任公司
注册地址： 深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A
办公地址：深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层
法定代表人：马昭明
联系人：盛宗凌、庞晓芸
电话：0755-82492000
传真：0755-82492962
客服电话：95513
公司网址：www.lhzq.com

(29)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

(30)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22层-29层
办公地址：上海市中山南路318号2号楼21层-29层
法定代表人：潘鑫军
联系人：吴宇
电话：021-63325888
传真：021-63326173
客服电话：021-962506
公司网址：www.dfzq.com.cn

(31)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：0755-82825551
传真：0755-82558305
客服电话：400-800-1001
公司网址：www.essence.com.cn

(32)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：025-84579763
联系人：程高峰
客服电话：95597
公司网址：www.htsc.com.cn

(33)中航证券有限公司
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
客服电话：400-8866-567
公司网址：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：郭磊
电话：0731-84403319
传真：0731-84403439
客服电话：0731-84403350
公司网址： 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：张智河
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

(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
公司网址：www.ebscn.com

(37)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：天津市南开区宾水西道8号
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

(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：许刚
电话：（021）50372474
传真：（021）50372474
客户服务电话：4006208888
公司网址：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：林生迎
客服电话：95565、400-8888-111
公司网址：www.newone.com.cn

(40)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

(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：庞介民
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

(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：0551-2246273
传真：0551-2272100
联系人：李蔡
客服电话：95578
公司网址： 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
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

(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
客服电话：021-52574550 0519-88166222 0379-64902266
免费服务热线：400-888-8588
公司网址：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21层
办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第18层至21层
法定代表人：杨明辉
联系人：刘毅
电话：0755-82023442
传真：0755-82026539
客服电话：400-600-8008
公司网址：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
客服电话：021-63340678
公司网址：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：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
联系人：潘鸿
电话：010-66045446
传真：010-66045500
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.txjijin.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
客服电话：4008209898
公司网址：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：郑舒丽
电话：0755-82400862
传真：0755-82433794
客服热线：4008816168
公司网址：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
客服电话：95579或4008-888-999
公司网址：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
公司网址：www.gfhfzq.com.cn

(52)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

(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

(54)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

(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
客服电话：4008918918
公司网址：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
客服电话：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

(58)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：010-60838888
传真：010-60833739
客服热线：95558
公司网址：www.cs.ecitic.com

(59)五矿证券有限责任公司
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

(60)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
电话：0755-33331188
传真：0755-33329815
客服热线：4006543218
公司网址：www.tyzq.com.cn

(61)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：王文学
联系人：黄旭成
电话：0755-82083788
传真：0755-82083408
客服热线：021-32109999，029-68918888
公司网址：www.cfsc.com.cn

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：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：江苏公证天业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、基金的名称

本基金名称：东吴新创业股票型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：股票型基金

六、基金的投资目标

本基金为股票型基金，主要投资于市场中的创业型股票，包括创业板股票、中小板股票和主板中的中小盘股票。通过精选具有合理价值的高成长创业型股票，追求超越市场的收益。

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，投资于创业型股票的比例不低于股票资产的80%，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%。本基金投资的创业型股票包括创业板股票、中小板股票和主板中的中小盘股票。本基金投资于权证、以及其它金融工具投资比例遵从法律法规及监管机构的规定。

对于中国证监会允许投资的其他金融工具，将依据有关法律法规进行投资管理。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。

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，动态的调整股票、债券、现金等大类资产的配置。运用本公司自行开发的东吴GARP策略选股模型，精选具有成长优势与估值优势的创业型上市公司股票。

本基金的投资策略主要体现在资产配置策略、选股策略、债券投资策略、权证投资策略等几方面。

1.资产配置策略

本基金采用定性与定量相结合的方法进行大类资产配置。定量方法本基金采用东吴资产配置BL模型为定性研究提供参考，本基金的投资研究团队将通过定性研究对定量研究的结果进行调整之后，形成最终的资产配置方案。

定性研究是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

本基金主要投资于市场中的创业型股票，包括创业板股票、中小板股票和主板中的中小盘股票。通过精选具有合理价值的高成长创业型股票，分享优质股票带来的高成长与高收益，追求超越市场的收益。

本基金采用了GARP（Growth at a Reasonable Price）的策略进行选股，所谓GARP策略，就是合理价格基础上的成长策略，其目标是寻找具有持续增长潜力但价格合理或低估的股票，核心思想是以相对较低的价格买入成长性较高的公司股票。这种策略不再简单的将股票划分为成长型或价值型股票，而是重视了成长潜力和市场价格的合理性，强调投资标的具备高速成长的优势，同时规避投资标的的估值过高的风险。这种策略很好的将价值和成长融合在了一起，吸收了传统的价值型和成长型识别标准中的科学合理的成分，剔除了传统的价值型和成长型识别标准中的非科学合理的成分，并补充了新的更加科学合理的识别成分和方法，以挖掘具有合理价格的成长型股票的投资机会，在追求高成长高收益的同时有效的控制了风险。

(1)本基金创业型股票池的构建

本基金投资于创业型股票的比例不低于股票资产的80%。本基金使用自主开发的东吴GARP策略选股模型专门用于构建创业型股票池，该模型分为三个模块，分别为市值筛选模块、成长模块和价值模块。

1)市值筛选

本基金至少有80%的股票资产投资于创业型股票，包括创业板股票、中小板股票和主板中的中小盘股票。因此，在构建创业型股票池的时候，将首先剔除总市值最大的三分之一的股票。本基金对大中小盘股票的划分标准是：将国内A股市场所有股票按照总市值进行排序，总市值最大的三分之一的股票为大盘股，总市值处于中间三分之一的股票为中盘股，总市值最小的三分之一的股票为小盘股。

2)成长模块

该模块的目标是量化股票的成长性，并计算衡量股票成长性的标准化得分。模块分为三个部分，分别是确定描述成长性的定量指标、确定各指标的权重和计算股票成长性分值。

①确定描述成长性的定量指标

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定量分析，确定最有效的指标。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5-1：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
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

②确定各指标分配权重

本基金使用遗传算法对过去12个月的历史数据进行分析，以筛选出上述各个指标对应的最优权重，即[illegible]。由于市场变化很快，在不同的市场环境下各指标的权重效果不断发生变化，因此本基金取滚动三年权重的加权平均值作为各指标的最终权重，给予N-3年结果以20%的权重，N-2年结果以30%的权重，N-1年结果以50%的权重。

③计算股票的成长性得分

将各项指标分别乘以权重并相加汇总，计算成长性指标综合得分（GI）即GI = 。将计算出的成长性指标综合得分（GI）按从大到小的顺序进行排列，选择前N%的股票进入价值模块筛选，其余股票剔除。

3)价值模块

该模块目标是使用量化得分衡量股票的价值性。对于进入本模块的股票，通过确定描述价值性的定量指标、确定各指标的权重和计算股票价值性分值三个部分，对股票进行筛选，形成本基金创业型股票池。

1)确定描述价值性的定量指标

本基金通过定性和定量相结合的方法来确定描述价值性的指标，最终选取以下五个指标作为本基金选取的衡量上市公司价值的指标。

表5-2：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

2)确定各指标分配权重

本基金使用遗传算法对过去12个月的历史数据进行分析，以筛选出上述各个指标对应的最优权重，即 。由于市场变化很快，在不同的市场环境下各指标的作用不断发生变化，因此本基金取滚动三年权重的加权平均值作为各指标的最终权重，给予N-3年结果以20%的权重，N-2年结果以30%的权重，N-1年结果以50%的权重。

3)计算股票的价值性指标综合得分

将各项指标分别乘以权重并相加汇总，计算价值性指标综合得分（VI）即VI = [illegible]。将计算出的价值性指标综合得分（VI）按从小到大的顺序进行排列，选择前M%的股票进入创业型股票池，其余股票剔除。这里的M%和成长模块的N%两个比例根据上市公司的数量以及股票池所需股票数量来确定。

4)本基金针对创业板市场和主板、中小企业板市场企业的不同，分别设计了“东吴基金创业板上市公司评价体系”和“东吴基金主板/中小板中小盘上市公司评价体系”。在利用东吴GARP选股模型得到创业型股票池之后，本基金根据这两个评价体系分别计算备选上市公司中创业板和主板/中小板股票的综合评价分值，评价中小企业的投资价值，精选出竞争优势综合分值排名前50%的中小企业股票作为基金核心股票池。

①东吴基金创业板上市公司评价体系

“东吴基金创业板上市公司评价体系”是在“东吴基金（主板/中小板）中小企业竞争优势评价体系”的基础之上，结合创业板上市公司规模小、技术密集、多属于新兴行业等特点，对战略管理优势、技术优势、市场优势、管理运营优势的评价标准进行了全面改进，重点突出管理层的创业精神和素质、企业技术优势和所处行业发展前景在创业板上市公司发展过程中发挥的关键作用。东吴基金创业板上市公司评价体系具体包括以下四方面内容：人力资源与战略管理优势、技术创新优势、行业与市场地位的领先度、盈利能力的质与量优势。评分准则为：

a.四大优势评分主要依据各大竞争优势具体内容进行。

b.评分采用四分法：很好（21~25）；较好（14~20）；一般（7~13）；较差（0~6）。

c.根据行业分析师评分结果，统计计算出上市公司竞争优势综合评分值=人力资源与战略管理优势+技术创新优势+行业与市场地位的领先度+盈利能力的质与量优势，作为创业板上市公司竞争优势的评价。

②东吴基金主板/中小板中小盘上市公司评价体系

“东吴基金主板/中小板中小盘上市公司评价体系”是根据波特五力分析模型（五力指供应商的讨价还价能力、购买者的讨价还价能力、潜在竞争者进入市场的能力、替代品的替代能力以及行业内竞争者现在的竞争能力）、价值链分析内容以及企业能力理论和企业资源理论等构建的，结合中小企业的特点，重点对中小企业的技术优势、市场优势的评价标准进行改进。“东吴基金主板/中小板中小盘上市公司评价体系”具体包括以下五方面内容：战略管理优势、技术优势、市场优势、管理运营优势、资源及其它附加优势。每个方面又有细分指标，评分准则为：

a.五大优势评分主要依据各大竞争优势具体内容进行。

b.战略管理优势、技术优势、市场优势、以及管理运营优势四大优势评分采用四分法：很好（21~25）；较好（14~20）；一般（7~13）；较差（0~6）。考虑附加优势对企业竞争优势有正有负影响，评分采用三分法：很好（6~10）；较好（1~5）；差（-10~0）。

c.根据行业分析师评分结果，统计计算出上市公司竞争优势综合评分值=战略管理优势+技术优势+市场优势+管理运营优势+附加优势，作为上市公司竞争优势的评价。

(2)本基金非创业型股票池的构建

本基金投资于非创业型股票的比例不高于股票资产的20%。对于这类股票的投资，将在已有的东吴双动力基金股票池的基础上，剔除属于“创业型股票池”的股票以及禁入股票，由此构建“非创业型股票池”。

3.债券投资策略

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。本基金会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：

(1)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。

(2)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=（中信标普200指数×50%+中信标普小盘指数×50%）×75%+中信标普全债指数×25%

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，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，在证券投资基金中属于预期风险较高、预期收益较高的基金产品。本基金力争通过资产配置、精选个股等投资策略的实施和积极的风险管理而追求较高收益。

十一、基金投资组合报告

东吴新创业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工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011年7月15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2011年6月30日基金资产组合情况：

序号	项目名称	金额（市值）	占基金资产总值比例（%）
1	权益投资	169,102,592.47	74.46
	其中：股票	169,102,592.47	74.46
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	银行存款和清算备付金	57,756,436.75	25.43
6	其它资产	238,936.83	0.11
7	合计	227,097,966.05	100.00

2、截至2011年6月30日按行业分类的股票投资组合：

代码	行业类别	股票市值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	7,082,000.00	3.13
C	制造业	130,317,397.64	57.69
C0	食品、饮料	25,809,873.90	11.43
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	49,137,997.27	21.75
C5	电子	7,174,622.40	3.18
C6	金属、非金属	15,028,488.36	6.65
C7	机械、设备、仪表	6,588,553.33	2.92
C8	医药、生物制品	26,577,862.38	11.76
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	21,660,465.60	9.59
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	2,066,000.00	0.91
H	批发和零售贸易	2,172,729.23	0.96
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	5,804,000.00	2.57
	合计	169,102,592.47	74.86

3、截至2011年6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：

序号	股票代码	股票名称	数量	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002140	东华科技	789,088	21,660,465.60	9.59
2	600143	金发科技	1,057,000	17,398,220.00	7.70
3	600111	包钢稀土	180,000	12,857,400.00	5.69
4	600809	山西汾酒	139,950	9,803,497.50	4.34
5	002214	大立科技	159,720	7,174,622.40	3.18
6	600803	威远生化	542,982	7,129,353.66	3.16
7	000792	盐湖股份	119,930	7,075,870.00	3.13
8	000596	古井贡酒	83,430	6,631,016.40	2.94
9	600315	上海家化	167,267	5,954,705.20	2.64
10	000869	张 裕A	60,000	5,928,000.00	2.62

4、截至2011年6月30日按券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2011年6月30日按市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2011年6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。

7、截至2011年6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。

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)期末其他资产构成

序号	项目名称	金额（元）
1	存出保证金	185,471.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,401.73
5	应收申购款	43,063.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	238,936.83

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券

本基金本报告期末未持有的处于转股期的可转换债券明细

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600315	上海家化	5,954,705.20	2.64	筹划资产重组事宜

(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。

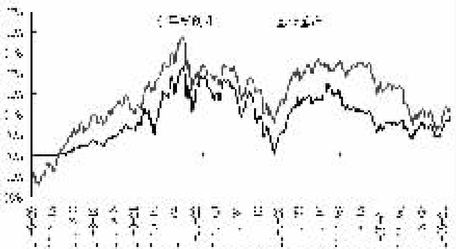
(1)东吴新创业基金历史时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

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
2010.06.29-2010.12.31	14.03%	1.23%	17.31%	1.31%	-3.28%	-0.08%
2011.01.01-2011.06.30	-4.17%	1.11%	-4.92%	1.04%	0.75%	0.07%
2010.06.29-2011.06.30	9.28%	1.17%	11.15%	1.19%	-1.87%	-0.02%

注：比较基准=（中信标普200指数×50%+中信标普小盘指数×50%）×75%+中信标普全债指数×25%，数据截止到2011年6月30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

（2010年06月29日至2011年6月30日）



注：东吴新创业基金于2010年6月29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

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前端收费（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）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：

中国农业银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行有限责任公司、烟台银行股份有限公司、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、中航证券有限责任公司、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、南京证券有限责任公司、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。

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、费用概览

（一）基金运作相关费用

1、管理费：

基金管理费以基金资产净值的1.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%年费率计提。

计算方法如下：

H=E×年管理费率÷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2个工作日内从基金财产中一次性支付给本基金管理人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、托管费：

基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25% 年费率计提。

计算方法如下：

H=E×年托管费率÷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2个工作日内从基金资产中一次性支付给本基金托管人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、基金合同生效后的信息披露费用；
4、基金合同生效后的会计师费和律师费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券交易费用；
7、银行手续费、服务费；
8、基金分红手续费。
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。

上述第3 项至第9 项费用由本基金管理人向基金托管人发出划款指令后，基金托管人按费用实际支出金额从基金财产中支付，列入当期基金费用。

（二）基金销售相关费用

1、本基金申购费由申购人承担，用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费，投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费。

2、投资者选择交纳前端申购费时，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。具体费率如下：

申购金额（含申购费）	前端申购费率
100万元以下	1.5%
100万元以上（含）-200万元以下	1.2%
200万元以上（含）-500万元以下	0.8%
500万元以上（含）	1000元/笔

3、赎回费随基金持有时间的增加而递减，费率如下：

持有时间	赎回费率
1 年以内（含1年）	0.5%
1 年-2年（含2年）	0.25%
2 年以上	0

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。其中，须依法扣除所收取赎回费总额的25%归入基金资产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

4.基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

（三）基金税收

1、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。

2、根据财政部、国家税务总局的财税字［1998］55号文、财税字 ［2001］61号文《关于证券投资基金税收问题的通知》及财税字［2004］78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》及其他相关税务法规，对基金主要税项规定如下：

1)以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

2)基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收营业税。

3)基金从证券市场中取得的收入包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4)基金买卖股票按卖出金额的0.1%缴纳证券交易（股票）印花税。

3、国家法律、法规有新规定的，从其规定。

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》、《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，更新了“所载内容截止日期”及“有关财务数据和净值表现截止日期”。

2、在“三、基金管理人”中，对基金管理人简要情况介绍，及主要人员情况等内容进行了更新。

3、在“四、基金托管人”中，对基金托管人基本情况、主要人员情况、基金托管业务经营情况进行了更新。

4、在“五、相关服务机构”中，增加了部分代销机构，更新了部分代销机构在报告期内的变化情况。

5、在“八、基金份额的申购与赎回”中，更新了基金转换业务的相关内容。

6、在“九、基金的投资”中，更新了基金投资组合报告的内容。数据内容截止时间为2011年6月30日。

7、在“十、基金的业绩”中，更新了基金业绩的内容。数据内容截止时间为2011年6月30日。

8、在“二十二、其他应披露事项”中，增加了其他披露事项：

(1)2010年12月31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参加交通银行网上银行、手机银行延长基金申购费率优惠的公告》、《东吴基金管理有限公司关于参加中国农业银行网上银行延长基金申购费率优惠的公告》、《东吴基金管理有限公司关于参加中国邮政储蓄银行有限责任公司网上交易系统延长基金申购费率优惠的公告》；

(2)2011年1月6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增加中国建设银行为代销机构并推出定投转换业务同时参与费率优惠活动的公告》；

(3)2011年1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关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告》；

(4)2011年1月24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《东吴新创业股票型证券投资基金2010年第4季度报告》；

(5)2011年1月31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基金在温州银行网上银行申购费率优惠的公告》；

(6)2011年2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基金在招商银行开通基金转换业务的公告》；

(7)2011年3月7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基金在天相投资顾问推出定投业务的公告》；

(8)2011年3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基金估值调整情况的公告》；

(9)2011年3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估值调整情况的公告》；

(10)2011年3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基金产品持有盐湖钾肥股票恢复市价估值法的公告》；

(11)2011年3月31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《关于旗下基金产品持有盐湖钾肥股票恢复市价估值法的公告》、《东吴基金管理有限公司关于旗下基金参加工商银行延长申购费率优惠活动的公告》；

(12)2011年4月6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基金参加华夏银行基金申购费率优惠的公告》；

(13)2011年4月7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基金产品持有大立科技股票恢复市价估值法的公告》；

(14)2011年4月8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基金在华夏银行延长定投申购费率优惠活动的公告》；

(15)2011年4月12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基金参加中国农业银行基金申购费率优惠活动的公告》；

(16)2011年4月21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《东吴新创业股票型证券投资基金2011年第1季度报告》；

(17)2011年5月5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中信证券为代销机构并推出定投及转换业务的公告》；

(18)2011年5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调整情况的公告》；

(19)2011年6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关于增加中信银行为代销机构并推出定投及转换业务的公告》；

(20)2011年6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关于旗下基金新增天源证券为代销机构并推出定投及转换业务的公告》、《东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增五矿证券为代销机构的公告》；

(21)2011年6月23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基金产品持有海印股份股票恢复市价估值法的公告》；

十五、签署日期

本基金更新招募说明书于2011年6月29日签署。

东吴基金管理有限公司
二零一一年八月十三日