东吴中证新兴产业指数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:中国农业银行股份有限公司

重要提示

本基金根据2010年12月9日中国证券监督管理委员会《关于同意东吴中证新兴产业指数证券投资基金募集的批复》(证监基金字【2010】【1792】号)的核准,进行募集。

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。

基金投资有风险,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2012年2月1日,有关财务数据和净值表现截止日为2011年12月31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,与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。

(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。现任东吴证券股份有限公司董事长、总裁,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、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。现任东吴证券股份有限公司董事长助理。

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。现任东吴证券股份有限公司副总裁,中共东吴证券股份有限公司党委纪委书记,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

王少成先生,1978年生,复旦大学物理化学专业硕士毕业,具有CPA和律师资格,9年证券从业经历。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,在新能源、新技术、普通机械和化工等行业具有多年研究和投资经验。2009年6月加入东吴基金管理有限公司,现担任东吴中证新兴产业指数基金经理、东吴新创业股票基金基金经理、东吴双动力基金经理。

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

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9F

法定代表人:蒋超良

成立时间:2009年1月15日

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:010-68424199

联系人:李芳菲

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。2009年1月15日,中国农业银行股份有限公司正式成立,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。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,表明了独立公正第三方对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"。

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,2004年9月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工130名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10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。

3、基金托管业务经营情况

截止2012年2月1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116只,包括东吴中证新兴产业指数证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500指数证券投资基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金(LOF)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元比联保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金。

(二)基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险与内控管理委员会直接负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。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,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(三)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户,基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;

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

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

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

(2)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)66107914
客服电话:95588
公司网址:www.icbc.com.cn

(3)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

(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)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

(6)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

(7)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

(8)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

(9)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:肖遂宁(Frank Neil Newman)
联系人:张青
电话:0755-82088888
传真:0755-82080406
客服电话:95501
公司网址:www.sdb.com.cn

(10)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)57092615
传真:(010)57092611
客服电话:95568
公司网址:www.cmbc.com.cn

(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

(12)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

(13)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

(14)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

(15)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

(16)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

(17)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

(18)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

(19)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

(20)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

(21)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、41和42楼
法定代表人:林治海
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

(22)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

(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

(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: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

(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
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

(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
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

(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: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.

(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
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

(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

(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、李芳芳
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:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人:王春峰
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

(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.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:021-32229888-3121
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:林爽
电话:010-66045608
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)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

(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:010-60833722
传真:010-60833739
客服热线:95558
公司网址:www.cs.ecitic.com

(59)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

(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:杨小江
电话:0755-82083788
传真:0755-82083408
客服热线:021-32109999,029-68918888
公司网址:www.cfsc.com.cn

(62)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
法定代表人:罗浩
电话:021-38784818
传真:021-68775878
联系人:倪丹
客户服务电话:68777877
公司网站:www.cf-clsa.com

(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: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:东吴中证新兴产业指数证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:股票型指数基金

六、基金的投资目标

本基金采用指数化投资,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%,以实现对标的指数的有效跟踪。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股、备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中,中证新兴产业指数成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产的90%,现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

因基金规模或市场变化等因素导致本基金投资组合不符合上述规定的,基金管理人将在10个工作日内调整至符合上述规定。法律、法规另有规定的,从其规定。

八、基金的投资策略

1、股票投资组合的构建

本基金对中证新兴产业指数进行完全复制,在初始建仓期或者为申购资金建仓时,本基金按照中证新兴产业指数各成份股所占权重逐步买入。在买入过程中,本基金采取相应的交易策略降低建仓成本,力求跟踪误差最小化。在投资运作过程中,本基金以标的指数权重为标准配置个股,并进行适时调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

2、股票投资组合的调整

(1)组合调整原则

本基金为完全复制的指数型基金,基金所构建的指数化投资组合将根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、配股增发因素等变化,对基金投资组合进行适时调整,以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。

(2)组合调整方法

1)定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据中证新兴产业指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。本基金将按照标的指数对成份股及其权重的调整方案,在考虑跟踪误差风险的基础上,对股票投资组合进行相应调整。

2)不定期调整

在一些特殊情况下,我们将适当调整投资标的。

①根据指数编制规则,当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时,本基金将根据标的指数权重比例的变化,进行相应调整。

②当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置,基金管理人将综合考虑跟踪误差和投资者利益,选择相关股票进行适当的替代。

③根据本基金的申购赎回情况,对组合进行相应调整,力求达到跟踪误差最小化。

3)在其他不影响指数复制的情况下,本基金管理人可以根据市场情况,在跟踪误差最小化的条件下,对基金资产组合进行适当的调整。

3、替代成份股的构建

本基金选择其他中证新兴产业指数成份股或备选成份股构建替代成份股。具体按照以下流程进行替代成份股的筛选:

(1)在中证新兴产业指数成份股中,筛选出被替代股票所在细分行业内的股票,作为替代成份股的备选池。

(2)通过"东吴优化筛选模型"筛选相同行业成份股进行替代,以估计替代时间的长短,作为模型计算的时间区间:

(3)使用东吴优化筛选系统计算出替代成份股的比例之后,由行业分析师对初选结果进行复议,从基本面角度考察用于替代的成分股是否合适用于替换目的,并酌情进行调整。

4、基金组合的优化策略

本基金对由于仓位限制、基金费用、成份股调整、申购赎回等因素会产生的跟踪误差,采取适当策略进行修正。

(1)成份股权重策略

针对建仓期间仓位未达到目标水平、应付赎回、配股增发的现金预留引起仓位不足、申购资金与分红资金等资金流入导致仓位不足、换股期间成分股操作引起仓位变动等导致基金仓位低于基准而产生的跟踪误差,该策略根据降低跟踪误差的原则,通过衡量相应成份股的基本面和流动性,在指数成份股标准权重的基础上进行微调。

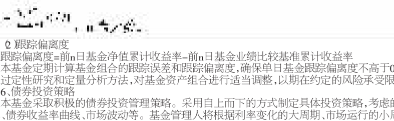
(2)交易策略

针对由于基金管理费、托管费、交易费用、冲击成本等因素产生的跟踪误差,该策略主要通过在基金建仓和成份股调整时,低买高卖或提前建仓以减小冲击成本等进行修正。

5、跟踪误差控制

本基金主要通过"跟踪误差"和"跟踪偏离度"两个指标,对跟踪误差进行控制管理,确保基金对指数的紧密跟踪。

(1)跟踪误差



(2)跟踪偏离度

跟踪偏离度=前n日基金净值累计收益率-前n日基金业绩比较基准累计收益率

本基金定期计算基金组合的跟踪误差和跟踪偏离度,确保单日基金跟踪偏离度不高于0.35%,年度跟踪误差不超过4%。特殊情况下,本基金通过定性研究和定量分析方法,对基金资产组合进行适当调整,以期在约定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。

6、债券投资策略

本基金采取积极的债券投资管理策略。采用自上而下的方式制定具体投资策略,考虑的主要因素是:宏观经济走势、资金供求状况、基础利率、债券收益率曲线、市场波动等。基金管理人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固定特性,结合基金申购赎回的情况,判断基金对流动性的需求,制定相应的债券投资策略。

本基金债券投资主要是流动性管理的需要、获取适当收益,因此债券投资以流动性好,风险较小的短期政府债券为主;中国的债券市场处于扩张阶段,品种不断丰富、衍生工具有所增加,本基金的债券投资将注重创新品种的选择和创新工具的运用,以流动性好、风险低的品种作为投资目标。

九、业绩比较基准

基金业绩比较基准=95%*中证新兴产业指数收益率+5%*银行同业存款利率

中证新兴产业指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数精选在上海证券交易所和深圳证券交易所中上市的规模大、流动性好的100家新兴产业公司作为样本,综合反映了沪深证券市场中新兴产业公司的整体表现。

本基金认为,该业绩比较基准目前能够有效地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金可以在履行适当程序后变更业绩比较基准。经与基金托管人协商一致,并在中国证监会指定的媒体以及公司网站上公告。

十、风险收益特征

本基金属于股票型基金,预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金以及混合型基金。本基金为指数型基金,紧密跟踪中证新兴产业指数,具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益也较高的品种。

十一、基金投资组合报告

本基金的投资组合将遵循以下限制:

1、持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的10%;

2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;

3、本基金参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

4、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定;

5、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的,从其规定。

若法律法规或监管部门取消上述限制,履行适当程序后,本基金投资可不受上述规定限制。

(九)禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

1、承销证券;

2、向他人贷款或者提供担保;

3、从事承担无限责任的投资;

4、买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;

5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;

7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

8、依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,履行适当程序后,本基金投资可不受上述规定限制。

(十)基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利,保护基金份额持有人的利益;

2、不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理;

3、有利于基金财产的安全与增值;

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

(十一)基金的融资、融券

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资、融券。

(十二)基金投资组合报告

东吴中证新兴产业指数证券投资基金(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农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年1月17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12月31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	1,142,089,236.37	94.20
	其中:股票	1,142,089,236.37	94.20
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	70,198,754.49	5.79
6	其它资产	114,419.45	0.01
7	合计	1,212,402,410.31	100.00

2、截至2011年12月31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	25,053,300.48	2.07
B	采掘业	25,951,854.21	2.15
C	制造业	776,650,774.71	64.20
C0	食品、饮料	9,333,323.19	0.77
C1	纺织、服装、皮毛	20,034,806.41	1.66
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	51,008,199.76	4.22
C5	电子	51,385,307.74	4.25
C6	金属、非金属	90,670,635.89	7.50
C7	机械、设备、仪表	361,166,030.65	29.86
C8	医药、生物制品	193,052,471.07	15.96
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	11,950,153.60	0.99
E	建筑业	14,964,201.50	1.24
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	174,284,921.19	14.41
H	批发和零售贸易	32,415,979.92	2.68
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	44,532,524.85	3.68
L	传播与文化产业	26,385,148.78	2.18
M	综合类	9,900,377.13	0.82
	合计	1,142,089,236.37	94.41

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2011年12月31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	600517	置信电气	1,299,957	19,122,367.47	1.58
2	600750	江中药业	621,198	18,014,742.00	1.49
3	002065	东华软件	788,162	17,386,853.72	1.44
4	000826	桑德环境	639,610	16,118,172.00	1.33
5	600557	康缘药业	1,071,828	15,766,589.88	1.30
6	600085	同仁堂	1,105,800	15,514,374.00	1.28
7	600066	宇通客车	655,244	15,503,073.04	1.28
8	600867	通化东宝	1,822,287	15,252,542.19	1.26
9	002310	东方园林	172,498	14,964,201.50	1.24
10	600276	恒瑞医药	506,168	14,901,585.92	1.23

(2)截至2011年12月31日积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

4、截至2011年12月31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12月31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12月31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12月31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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,930.09
5	应收申购款	98,489.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	-

(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)报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

(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。

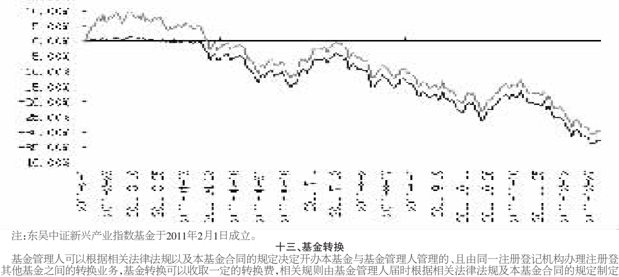
(1)东吴新创业基金历史时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

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
2011.02.01-2011.12.31	-32.70%	1.27%	-29.54%	1.40%	-3.16%	-0.13%

注:基金业绩比较基准=95%*中证新兴产业指数收益率+5%*银行同业存款利率,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比较基准收益率的比较图

(2011年02月01日至2011年12月31日)



注:东吴中证新兴产业指数基金于2011年2月1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、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、深发展银行股份有限公司、申银万国证券有限责任公司、民生银行股份有限公司、邮政储蓄银行有限责任公司、华夏银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、温州银行股份有限公司、天相投资顾问有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、东方证券有限责任公司、长城证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、南京证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、世纪证券有限责任公司、中航证券有限公司、广发华福证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、财富证券有限公司、广州证券有限责任公司、厦门证券有限责任公司、中信证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司、中银国际证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、金元证券股份有限公司。

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、基金合同生效后的信息披露费用;

4、基金份额持有人大会费用;

5、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

6、基金的证券交易费用;

7、基金财产拨划支付的银行费用;

8、基金的指数使用费;

9、按照国家有关规定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法规规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规和基金合同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年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为1%

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3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年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.15%

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3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、上述(一)中3到8项费用由基金托管人根据其他有关法律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。基金募集期间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,基金收取认购费的,可以从认购费中列支。

(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。降低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

(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,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12月31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12月31日。

8、在"二十二、其他应披露事项"中,增加了其他披露事项:

(1)2011年8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参加长江证券基金交易费率优惠活动的公告》;

(2)2011年8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《东吴中证新兴产业指数证券投资基金2011年半年度报告》;

(3)2011年9月1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宝证券网上交易系统申购费率优惠的公告》;

(4)2011年9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产品持有上海家化股票恢复市价估值法的公告》;

(5)2011年9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旗下证券投资基金估值调整情况的公告》;

(6)2011年9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》;

(7)2011年9月30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》;

(8)2011年10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旗下基金产品持有棕榈园林股票恢复市价估值法的公告》;

(9)2011年10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《东吴中证新兴产业指数证券投资基金2011年第3季度报告》;

(10)2011年11月3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安证券网上申购费率及定投申购费率优惠的公告》;

(11)2011年11月19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》;

(12)2011年12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中信万通证券推出定投业务的公告》;

(13)2011年12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调整情况的公告》;

(14)2011年12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参加广发证券定投费率优惠活动的公告》;

(15)2011年12月28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中银国际证券开通转换业务的公告》、《东吴基金管理有限公司关于在中国中投证券开通转换业务的公告》;

(16)2011年12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在金元证券开通转换业务的公告》;

(17)2011年12月30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邮政储蓄银行网上银行延长基金申购费率优惠活动的公告》、《东吴基金管理有限公司关于参加华夏银行网上银行申购费率及定投费率优惠的公告》;

(18)2011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中国农业银行网上银行延长基金申购费率优惠的公告》;

(19)2011年1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财富里昂证券为代销机构的公告》;

(20)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旗下证券投资基金估值调整情况的公告》;

(21)2011年1月19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中证新兴产业指数证券投资基金2011年第4季度报告》;

十六、签署日期

本基金更新招募说明书于2012年2月1日签署。

东吴基金管理有限公司
二零一二年三月十六日