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2012年12月29日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年9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【2004】32 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:4008210588
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、零售业务总部、机构理财部、基金事务部、信息技术部、总裁办、子政事务部、财务管理部、专户投资部、固定收益部和监察稽核部等14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11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,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。

(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副局长、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,东吴证券有限责任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,东吴证券有限责任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经济学院讲师、副教授,现任苏州大学商学院财经学院教授。

张平光先生,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。

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、代任督察长,(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月加入东吴基金管理有限公司任市场总监职务;2008年7月起至今任东吴基金管理有限公司副总经理。

4.基金经理

周健先生,硕士,6年的证券从业经历,2006年8月至2011年5月任职于海通证券。2011年5月加入东吴基金管理有限公司,曾任研究策划部研究员。2012年5月至今担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理,2012年10月22日起担任本基金基金经理。

5.投资决策委员会成员

任少华 总经理;

黎 瑛 研究总监、研究策划部总经理;

陈 岚 首席策略规划师;

唐悦益 投资副总监兼投资管理部总经理,东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金基金经理、东吴深证100指数增强型证券投资基金基金经理,东吴价值成长双动力股票型证券投资基金经理;

任 桂 研究副总监兼研究策划部副总经理,东吴行业轮动股票型证券投资基金基金经理、东吴新产业精选股票型证券投资基金;

丁 蕙 东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理,东吴保本混合型证券投资基金基金经理;

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2012年12月末,中国工商银行资产托管部共有员工157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2012年12月,中国工商银行共托管证券投资基金282只,其中封闭式5只,开放式277只。自2003 年以来,本行连续九年获得香港《亚洲货币》、英国《金融托管人》、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35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:任少华

联系人:吴靖

直销电话:(021)50509880

传真:(021)50509884

客户服务电话:4008210588

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:刘一宁

电话:(010)85108227

传真:(010)85109219

客服电话:95599

公司网址:www.abchina.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

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

(3)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

(4)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

(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:赵晖

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:蒋贤

电话:010(85237356

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:邓剑鹏

电话:0755(83198888

传真:(0755) 83195049

客服电话:95555

公司网址: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:董云巍

电话:(010)57092615

传真:(010)57092611

客服电话:95568

公司网址: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:胡技勤

电话:(0574)87050024

传真:(0574)87050024

客服电话:96528,上海地区962528

公司网址:www.nbcb.com.cn

(10)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

(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:刘晓楠

电话:0755-22168532

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)浦谷银行股份有限公司

注册地址:烟台芝罘区海港路25号

办公地址:烟台芝罘区海港路25号

法定代表人:庄永辉

联系人:刘杰

电话:0535-6699663

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:上海市海海中路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)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:牟孟宇

电话:0755-83709350

传真:0755-83704850

客服热线:95563

公司网址:www.ghzq.com.cn

(19)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:北京市朝与大街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

(20)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

(21)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:0571-88920897

公司网址:http://www.ijijin.com.cn

(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

(23)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1、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1、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 及 www.jjmmw.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:张巍华

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:滕建辉

联系人:徐欢

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:吴倩

电话:(021)38676767

传真:(021)38670767

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)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:孟治海

联系人:马欣雨

电话:0755[83026025

传真:0755]83025625

客服电话:4008-888-228

公司网址:www.jyzq.com.cn

(29)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

(30)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笋岗路大厦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

(31)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:沈万菁

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

(32)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: 戴雷

电话:0791-86768681

传真:0791-86770178

客服电话:400-8866-567

公司网址:www.avicsec.com

(33)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: 周晓

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

(34)中信万通证券有限责任公司

注册地址:青岛市崂山区前海路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:吴静

客服电话: 0532-96577

公司网址:www.zxwt.com.cn

(35)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:刘腾、李芳芳

客服电话:4008888788、10108998

公司网址:www.ebscn.com

(36)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

(37)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

传真:(021)50372474

客户服务电话:4006208888

公司网址:www.boci.china.com

(38)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

(39)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

(40)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:蔺瑾

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

(41)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

(42)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:水颖

电话:025-83367888

传真:025-83320066

客服电话:400-828-5888

公司网址: www.njzq.com.cn

(43)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:梁旭

联系电话:0519-88157761

联系地址:0519-88157761

免费服务热线:400-888-8588

公司网址:www.longone.com.cn

(44)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:邵林

联系人:戴莉莉

电话:021-32229888-25122

传真:021-62878783

客服电话:021-63340678

公司网址:www.ajzq.com

(45)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

(46)长安证券有限责任公司

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:陈琳

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

(47)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

(48)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

(49)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:张鹏

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

(50)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

(51)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

(52)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

(53)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

(54)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: 林浩茹

电话:020-87322668

传真:020-87325036

客服电话:020-961303

公司网址:www.gzs.com.cn

(55)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

(56)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:北京市朝阳区光华路裙楼4B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

(57)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:魏晓

电话:0755-33331188

传真:0755-33329815

客服热线:4006543218

公司网址:www.tyzq.com.cn

(58)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

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

(59)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588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588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

客户服务电话:0571-96598

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。

(一)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:4008210588

网站: www.scfund.com.cn

(二)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号金融街中心南楼六层

办公地址:北京市西城区金融大街9号金融街中心南楼六层

负责人:黄炎明

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:吴瑞玉

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联动前提下,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GARPGuide 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W_{EG}、W_{REG}、W_{RRG}、W_{ROA}、W_{NAV};由于市场变化剧烈,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$GI=EG\times w_{EG}+REG\times w_{REG}+ROE\times w_{ROE}+EROE\times w_{EROE}+ROA\times w_{ROA}+NAV\times w_{NAV}$;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

[illegible]

4