东吴行业轮动混合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：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，本基金的基金合同于2008年4月23日正式生效。本基金于2015年8月7日更名为东吴行业轮动混合型证券投资基金。

基金管理人保证《东吴行业轮动混合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。

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，个别证券特有的非系统性风险，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》。

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2018年10月23日，有关财务数据和净值表现截止日为2018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
名称：东吴基金管理有限公司
住所：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：王炯
设立日期：2004年9月2日
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
组织形式：有限责任公司（国内合资）
注册资本：1亿元人民币
联系人：贾云鹏
电话：（021）50509888
传真：（021）50509884
客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、021-50509666
公司网址：www.scfund.com.cn

1、股权结构：

持股单位	占总股本比例
东吴证券股份有限公司	70%
海澜集团有限公司	30%
合计	100%

2、简要情况介绍：

公司实行董事会领导下的总经理负责制，公司总经理下设权益投资决策、固收投资决策、专户投资决策、风险管理、基金资产估值五个专门委员会；公司设有权益投资总部、固定收益总部、专户投资总部、研究策划部、集中交易室、营销管理总部、产品策略部、信息技术部、基金事务部、综合管理部、合规风控部十一个部门。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

马震亚先生，董事长，硕士，高级经济师，会计师，中共党员。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副总经理（主持工作）；东吴证券有限责任公司财务部总经理，财务总监，东吴证券股份有限公司党委委员、纪委书记、董事、副总裁、财务负责人，现任东吴基金管理有限公司董事长。

汤勇先生，董事，工商管理EMBA，注册会计师，中共党员。任江苏悦达时装有限公司财务会计、新能（张家港）能源有限公司计财处主任，现任海澜集团有限公司海澜资本投资部投资总监。

王炯先生，董事，硕士研究生，经济师，中共党员。历任苏州市统计局综合平衡处科员，东吴证券总裁办公室主任、机构客户部总经理、总裁助理、东吴证券上海分公司总经理，东吴基金管理有限公司常务副总经理。现任东吴基金管理有限公司总经理。

冯恂女士，董事，博士研究生，经济师，中共党员。历任东吴证券研究所研究员，国联证券研究所所长、总裁助理兼经管总部总经理、副总裁，东吴证券总规划师兼研究所所长、兼资产管理部总经理、总规划师，现任东吴证券股份有限公司副总裁。

陈建国先生，董事，硕士研究生，经济师，中共党员。历任昆山市信托投资公司第二证券部副经理，东吴证券昆山前进中路证券营业部总经理、福州湖东路证券营业部总经理、昆山分公司副总经理、东吴证券经纪管理总部副总经理（主持工作），现任东吴证券人力资源部总经理。

周虹女士，董事，本科学历，现任海澜集团有限公司海澜资本投资部投资经理。

张婉苏女士，独立董事，经济法学博士。历任担任斯洛文尼亚道迈尔机电有限责任公司苏州代表处法律顾问、南京大学法学院助教、讲师，现任南京大学法学院副教授。

袁勇志先生，独立董事，教授，博士生导师。历任苏州大学管理学院教师、苏州大学人文社科处处长、苏州大学党委研究生工作部部长，现任苏州大学出版社副总编。

方志刚先生，独立董事，大学学历，民建会员。企业类会计师、中国注册会计师、澳洲注册会计师。历任上海上审会计师事务所审计员、部门经理，上海长信会计师事务所部门经理，上海锦江国旅股份有限公司财务部经理、上海实业联合集团长城药业有限公司财务总监；上海众华沪银会计师事务所高级经理，现任瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）上海分所工作，权益合伙人，兼任长方集团股份有限公司独立董事。

2、监事会成员

张剑宏先生，监事会主席，硕士。历任苏州物资集团公司公司政策研究室科长、财务公司证券部总经理助理、办公室副主任、主任；东吴证券三香路营业部（原苏物贸证券营业部）总经理、总裁助理兼投资银行总部总经理、风险管理部、合规法务部总经理、合规总监兼首席风险官，现任东吴证券股份有限公司首席风险官。

王菁女士，监事，本科学士学位，会计师，中共党员。历任东吴证券经纪分公司财务经理、东吴证券财务部总经理助理、副总经理，现任东吴证券股份有限公司财务部副总经理。

沈清韵女士，员工监事，硕士研究生，中共党员。历任普华永道中天会计师事务所高级审计员，东吴基金管理有限公司监察稽核部副总经理，监察稽核部总经理，现任合规风控副总监兼合规风控部总经理，董事会秘书。

3、高级管理人员

马震亚先生，董事长，硕士，高级经济师，会计师，中共党员。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副总经理（主持工作）；东吴证券有限责任公司财务部总经理，财务总监，东吴证券股份有限公司党委委员、纪委书记、董事、副总裁、财务负责人，现任东吴基金管理有限公司董事长。

王炯先生，董事，硕士研究生，经济师，中共党员。历任苏州市统计局综合平衡处科员，东吴证券总裁办公室主任、机构客户部总经理、总裁助理、东吴证券上海分公司总经理，东吴基金管理有限公司常务副总经理，现任东吴基金管理有限公司总经理。

徐明先生，副总经理，硕士，中共党员。历任中国银行苏州分行营业部会计；苏州华纺经济贸易有限公司财务科会计；中创证券有限责任公司苏州十全街营业部副总经理；东吴证券有限责任公司胥江路证券营业部副总经理，总经理；东吴证券股份有限公司石路证券营业部总经理，太仓分公司总经理，常熟分公司总经理；东吴基金管理有限公司营销总监兼营销管理部总经理，现任东吴基金管理有限公司副总经理兼营销管理部总经理。

吕晖先生，督察长，大专，历任苏州商业大厦业务员，苏州证券公司交易员，苏州证券登记公司总经理助理，东吴证券资产管理总部副总经理，东吴证券吴江盛泽西环路营业部、吴江中山北路营业部总经理，东吴基金管理有限公司总经理助理、运营总监、东吴基金管理有限公司副总经理，现任东吴基金管理有限公司督察长。

4、基金经理

现任基金经理：

王立立，硕士，复旦大学世界经济专业。2010年7月至2010年12月就职于中信建投证券有限责任公司投资银行部任经理，2011年1月至2012年7月就职于上海汇利资产管理公司研究部任研究员，自2012年7月起加入东吴基金管理有限公司，曾任研究策划部行业研究员、基金经理助理，现任权益投资总部副总经理、基金经理，其中，自2015年2月6日起担任东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、自2015年5月29日起担任东吴行业轮动混合型证券投资基金基金经理。其中，2015年12月30日至2017年4月19日担任东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2013年12月24日至2018年2月27日担任东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金经理，2014年6月14日至2018年3月3日担任东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

历任基金经理：
庞良永，2008年4月23日至2009年5月4日任本基金基金经理。
任壮，2009年1月20日至2014年1月24日任本基金基金经理。
刘元海，2014年1月14日至2015年5月29日任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

（1）权益投资决策委员会：王炯、彭敢、程涛、杨庆定、杜毅、付琦、刘元海、戴斌、王立立。王炯任权益投资决策委员会主席，彭敢、程涛为权益投资决策委员会副主席。

（2）固收投资决策委员会：王炯、杨庆定、付琦、周明。王炯任固收投资决策委员会主席，杨庆定、周明为固收投资决策委员会副主席。

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：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：李民吉
成立时间：1992年10月14日
组织形式：股份有限公司
注册资本：12,822,686,653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
联系人：郑鹏
电话：（010）85238667
传真：（010）85238680

2、主要人员情况

华夏银行资产托管部内设市场一室、市场二室、风险与合规管理室和运营室4个职能处室。资产托管部共有员工39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核准，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“安全保管基金资产、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2018年9月末，托管证券投资基金、券商资产管理计划、银行理财、保险资管计划、资产支持专项计划、股权投资基金等各类产品合计4155只，全行资产托管规模达到26606.92亿元。

（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，保证基金资产的安全完整，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

风险管理委员会负责华夏银行股份有限公司的风险管理与内控制工作，总行审计部对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管部内部专门设置了风险与合规管理室，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的职权和能力。

3、内部风险控制的原则

（1）合法性原则：必须符合国家及监管部门的法律法规和各项制度并贯穿于 托管业务经营管理活动的始终；

（2）完整性原则：一切业务、管理活动的发生都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约必须渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖到资产托管部所有的部门、岗位和人员；

（3）及时性原则：托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度；

（4）审慎性原则：必须实现防范风险、审慎经营，保证基金财产的安全与完整；

（5）有效性原则：必须根据国家政策、法律及华夏银行经营管理的发展变化进行适时修订；必须保证制度的全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外；

（6）独立性原则：资产托管部内部专门设置了风险与合规管理室，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的职权和能力。

4、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理办法、实施细则、岗位职责、业务操作流程等，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；专门设置业务操作区，封闭管理，实施音像监控；指定专人负责受托资产的信息披露工作，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进行监督的方法和程序

托管人根据《基金法》、《运作办法》、其他相关法律法规及基金合同的规定，对基金投资范围、投资对象、投资比例、融资比例、基金投资禁止行为、基金资产净值计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金收益分配、相关信息披露等进行监督。

1、基金托管人发现基金管理人有违反《基金法》、《运作办法》、其他相关法律法规及基金合同规定的行为，应及时通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

2、对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

3、基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：
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：王炯
联系人：贾云鹏
直销电话：（021）50509880
传真：（021）50509884
客户服务电话：400-821-0588
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
客服电话：95588
公司网址：www.icbc.com.cn

（2）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：周慕冰
客服电话：95599
公司网址：www.abchina.com

（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
客服电话：95533
公司网址：www.ccb.com

（4）交通银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路188号
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：彭纯
客服电话：95559
公司网址：www.bankcomm.com

（5）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：李建红
客服电话：95555
公司网址：www.cmbchina.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
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人：田国立
客服电话：95558
公司网址：http://bank.ecitic.com

（7）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：洪崎
客服电话：95568
公司网址：www.cmbc.com.cn

（8）中国邮政储蓄银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街3号
办公地址：北京市西城区金融大街3号
法定代表人：李国华
客服电话：95580
公司网址：www.psbc.com

（9）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：李民吉
客户服务电话：95577
公司网址：www.hxb.com.cn

（10）平安银行股份有限公司
注册地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦
办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人：谢永林
客服电话：40066-99999（免长途费）0755-961202
公司网址：www.pingan.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：宁波市鄞州区宁南南路700号宁波银行大楼
法定代表人：陆华裕
客服电话：96528，上海地区962528
公司网址：www.nbcb.com.cn

（12）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
客服电话：0577-96699
公司网址：www.wzbank.cn

（13）烟台银行股份有限公司
注册地址：烟台市芝罘区海港路25号
办公地址：烟台市芝罘区海港路25号
法定代表人：叶文君
客服电话：4008-311-777
公司网址：www.yantaibank.net

（14）江苏银行股份有限公司
注册地址：南京市中华路26号
办公地址：南京市中华路26号
法定代表人：夏平
客服热线：95319
公司网址：www.jsbchina.cn

（15）苏州银行股份有限公司
注册地址：江苏省苏州市工业园区钟园路728号
办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路728号
法定代表人：王兰凤
客服热线：96067
公司网址：www.suzhoubank.com

（16）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：北京市西城区新街口外大街28号C座505
法定代表人：林义相
公司网址：http://www.txsec.com

（17）和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
客服热线：400-920-0022
公司网址：http://licaike.hexun.com/

（18）诺亚正行基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋
法定代表人：汪静波
客服热线：400-821-5399
公司网址：www.noah-fund.com

（19）深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼
办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼
法定代表人：薛峰
客服热线：4006-788-887
公司网址：www.zlfund.cn及www.jjmmw.com

（20）上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦
法定代表人：其实
客服热线：95021/400-1818-188
公司网址：http://fund.eastmoney.com

（21）上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室
法定代表人：杨文斌
客服热线：400-700-9665
公司网址：www.ehowbuy.com

（22）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座
法定代表人：陈柏青
客服热线：4000766123
公司网址：www.fund123.cn

（23）上海长量基金销售投资顾问有限公司
代销机构：上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人：张跃伟
客服电话：400-820-2899
公司网站：www.erichfund.com

（24）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：杭州市余杭区五常街道同顺路18号同花顺大楼
法定代表人：凌顺平
客服热线：4008-773-772
公司网址：www.5ifund.com

（25）上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海市浦东新区峨山路91弄61号10号楼14层
法定代表人：李兴春
客服电话：400-921-7755
公司网址：www.leadfund.com.cn

（26）浙江金观诚基金销售有限公司
注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室
办公地址：杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦一楼金观诚财富
法定代表人：蒋雪琦
客服热线：400-068-0058
公司网址：www.jincheng-fund.com

（27）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人：戎兵
客服热线：400-6099-200
公司网址：www.yixinfund.com

（28）南京苏宁基金销售有限公司
注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人：王锋
客服热线：95177
公司网址：www.snjijin.com

（29）北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人：周斌
客服热线：4008980618
公司网址：www.chtfund.com

（30）北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层1108号
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层
法定代表人：王伟刚
客服热线：400-619-9059
公司网址：www.hcjijin.com

（31）北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址：北京市朝阳区万通中心D座21&28层
法定代表人：蒋煜
客服热线：010-58170761
公司网址：http://www.shengshiview.com.cn/

（32）一路财富（北京）信息科技有限公司
注册地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
办公地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人：吴雪秀
客服热线：400-001-1566
公司网址：http://www.yilucaifu.com

（33）北京钱景基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人：赵荣春
客服热线：400-678-5095
公司网址：www.qianjing.com

（34）成都华羿恒信基金销售有限公司
注册地址：成都市高新区蜀锦路88号新中泰国际大厦1号楼32F2号
办公地址：成都市高新区蜀锦路88号新中泰国际大厦1号楼32F2号
法定代表人：赵壁
客服热线：028-87326832
公司网址：http://www.huayihengxin.com

（35）北京加和基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街11号7层703室
办公地址：北京市西城区金融大街11号7层703室
法定代表人：曲阳
客服热线：400-803-1188
公司网址：http://www.bzfunds.com/

（36）杭州科地瑞富基金销售有限公司
注册地址：杭州市下城区武林时代商务中心1604室
办公地址：杭州市下城区上塘路15号武林时代20F
法定代表人：陈刚
客服热线：0571-86915761
公司网址：www.cd121.com

（37）上海万得基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：上海市浦东新区福山路33号8楼
法定代表人：王廷富
客服热线：400-821-0203

（38）上海联泰资产管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层
法定代表人：燕斌
客服热线：400-166-6788
公司网址：http://www.66zichan.com

（39）上海汇付基金销售有限公司
注册地址：上海市黄浦区黄河路333号201室A区056单元
办公地址：上海市宜山路700号普天信息产业园2期C5栋汇付天下总部大楼2楼
法定代表人：金佶
客服热线：400-821-3999
公司网址：www.hotjijin.com

（40）北京微动利基金销售有限公司
注册地址：北京市石景山区古城西路113号3层342室
办公地址：北京市石景山区古城西路113号3层342室
法定代表人：季长军
客服热线：400-188-5687
公司网址：www.buyforyou.com.cn

（41）上海基煜基金销售有限公司
注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室
法定代表人：王翔
客服热线：400-820-5369
公司网址：www.jiyufund.com.cn

（42）上海陆金所基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：王之光
客户服务电话：4008219031
网址：www.lufunds.com

（43）大泰金石基金销售有限公司
注册地址：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
办公地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼
法定代表人：姚杨
客服热线：021-22267943
公司网址：http://www.dtfortune.com/

（44）珠海盈米财富管理有限公司
注册地址：珠海市横琴区宝华路6号105室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1201-1203室（邮编：510308）
法定代表人：肖雯
客户服务电话：020-89629066
网址：http://www.yingmi.cn/

（45）奕丰基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人：TEOWEEHOWE（张伟豪）
客服热线：400-684-0500
公司网址：www.ifastps.com.cn

（46）中民财富管理（上海）有限公司
注册地址：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层
法定代表人：弭洪军
客服热线：400-876-5716
公司网址：www.cmiwm.com

（47）中信期货有限公司
注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人：张皓
客户服务电话：400-990-8826
网址：www.citicsf.com

（48）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路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：杨德红
客户服务热线：95521/4008888666
公司网址：http://www.gtja.com

（49）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
客服电话：400-8888-108
公司网址：www.csc108.com

（50）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号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人：何如
客服电话：95536
公司网址：www.guosen.com.cn

（51）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：霍达
客服电话：95565、4008888111
公司网址：www.newone.com.cn

（52）广发证券股份有限公司
注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人：孙树明
客服电话：95575或致电各地营业网点
公司网址：www.gf.com.cn

（53）中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
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：张佑君
客服热线：95548
公司网址：www.cs.ecitic.com

（54）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2-6层
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：陈共炎
客服电话：4008-888-888或95551
公司网址：www.chinastock.com.cn

（55）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市广东路689号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：周杰
客服电话：021-23219000
公司网址：www.htsec.com

（56）申万宏源证券有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层（邮编：200031）
客服电话：95523或4008895523
公司网址：www.swhysc.com
联系人：黄莹

（57）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
办公地址：上海市浦东新区长柳路36号
法定代表人：杨华辉
客服电话：95562
公司网址：www.xyzq.com

（58）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：尤习贵
客服电话：95579或4008-888-999
公司网址：www.95579.com

（59）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：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02
法定代表人：王连志
客服电话：95517
公司网址：www.essence.com.cn

（60）西南证券股份有限公司
注册地址：重庆市江北区桥北苑8号
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人：吴坚
客服热线：95355、4008096096
公司网址：www.swsc.com.cn

（61）湘财证券股份有限公司
注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人：孙永祥
客服电话：95351
公司网址：www.xcsc.com

（62）万联证券股份有限公司
注册地址：广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19层
办公地址：广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19层
法定代表人：张建军
客服热线：4008888133
公司网址：www.wlzq.com.cn

（63）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
客服电话：95578
公司网址：www.gyzq.com.cn

（64）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：王春峰
客服电话：400-6515-988
公司网址：www.ewww.com.cn

（65）华泰证券股份有限公司
注册地址：南京市江东中路228号
办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场
法定代表人：周易
客服电话：95597
公司网址：www.htsc.com.cn

（66）中信证券（山东）有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层
法定代表人：姜晓林
客服电话：95548
公司网址：www.zxzqsd.com.cn

（67）东吴证券股份有限公司
注册地址：苏州工业园区星阳街5号
办公地址：苏州工业园区星阳街5号
法定代表人：范力
客服电话：0512-3339628895530
公司网址：www.dwzq.com.cn

（68）信达证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：张志刚
客服电话：95321
公司网址：www.cindasc.com

（69）东方证券股份有限公司
注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25-29层
办公地址：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25-29层
法定代表人：潘鑫军
客服电话：95503
公司网址：www.dfzq.com.cn

（70）长城证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17楼
办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17楼
法定代表人：丁益
客服电话：400-6666-888
公司网址：www.cgws.com

（71）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：周健男
客服电话：95525
公司网址：www.ebscn.com

（72）广州证券股份有限公司
注册地址：广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19、20楼
办公地址：广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19、20楼
法定代表人：邱三发
客服电话：020-961303
公司网址：www.gzs.com.cn

（73）南京证券股份有限公司
注册地址：南京市江东中路389号
办公地址：南京市江东中路389号
法定代表人：步国旬
客服电话：95386
公司网址：www.njzq.com.cn

（74）上海证券有限责任公司
注册地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼
办公地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼
法定代表人：李俊杰
传真：021-53686100，021-53686200
网址：www.shzq.com

（75）国联证券股份有限公司
注册地址：无锡市金融一街8号
办公地址：无锡市金融一街8号国联大厦
法定代表人：姚志勇
客服电话：95570
公司网址：www.glsc.com.cn

（76）平安证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层（518048）
法定代表人：谢永林
客服热线：95511-8
公司网址：www.PINGAN.com

（77）华安证券股份有限公司
注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
法定代表人：章宏韬
客服电话：95318
公司网址：www.hazq.com

（78）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：何春梅
客服热线：95563
公司网址：www.ghzq.com.cn

（79）财富证券有限责任公司
注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
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26-28楼
法定代表人：蔡一兵
客服电话：95317
公司网址：www.cfzq.com

（80）东海证券股份有限公司
注册地址：江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：赵俊
客服电话：95531；400-8888-588
网址：www.longone.com.cn

（81）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
客户服务电话：4006208888
公司网址：www.bocichina.com

（82）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
客服电话：0471-4961259
公司网址：www.cnht.com.cn

（83）申万宏源（西部）证券有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室（邮编：830002）
法定代表人：韩志谦
客户服务电话：400-800-0562
网址：www.hysec.com

（84）中泰证券股份有限公司
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
客服电话：95538
公司网址：www.qlzq.com.cn

（85）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：姜昧军
客服电话：4008323000
公司网址：www.csco.com.cn

（86）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：深圳市福田区深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人：王作义
客服电话：95372
公司网址：www.jyzq.com.cn

（87）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：北京市朝阳区望京东园四区2号中航资本大厦35层
法定代表人：王晓峰
客服电话：95335
公司网址：www.avicsec.com

（88）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
客服电话：0591-96326（福建省外请先拨0591）
公司网址：www.hfzq.com.cn

（89）上海华信证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
法定代表人：罗浩
客服热线：68777877
公司网址：www.cf-clsa.com

（90）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：张永衡
客服热线：40018-40028
公司网址：www.wkzq.com.cn

（91）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：上海市徐汇区宛平南路8号
法定代表人：俞洋
客户服务电话：95323；4001099918
公司网站：www.cfsc.com.cn

（92）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
客服热线：4006008008
公司网址：www.china-invs.cn

（93）九州证券股份有限公司
注册地址：青海省西宁市南川工业园区创业路108号
办公地址：北京市朝阳区安立路30号仰山公园东一门2号楼
法定代表人：魏先锋
客服热线：95305
公司网址：http://www.jzsec.com

（94）国金证券股份有限公司
注册地址：四川省成都市东城根上街95号
办公地址：四川省成都市东城根上街95号
法定代表人：冉云
客服热线：95310
公司网址：www.gjzq.com.cn

（95）华宝证券有限责任公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层
法定代表人：陈林
客服电话：4008209898
公司网址：www.cnhbstock.com

（96）长城国瑞证券有限公司
注册地址：厦门市思明区莲前西路2号莲富大厦17楼
办公地址：厦门市思明区深田路46号深田国际大厦20楼
法定代表人：王勇
客服热线：400-0099-886
公司网址：www.gwgsc.com

（97）爱建证券有限责任公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼
法定代表人：祝健
客服电话：4001962502
公司网址：www.ajzq.com

（98）金惠家保险代理有限公司
注册地址：北京市西城区阜成门外大街2号19层A2107
办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号19层A2107
法定代表人：夏予柱
客服热线：400-8557333
公司网址：www.jhjfund.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：王炯
联系人：贾云鹏
电话：021-50509888
传真：021-50509884
客户服务电话：400-821-0588
网站：www.scfund.com.cn

（三）律师事务所和经办律师
名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：俞卫锋
电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
联系人：陆奇
经办律师：黎明、陆奇

（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称：安永华明会计师事务所有限公司
注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼
法定代表人：葛明
联系电话：021-22288888
传真：021-22280000
联系人：徐艳
经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

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混合型证券投资基金(基金代码：580002）、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）、东吴新经济混合型证券投资基金(基金代码：580006）、东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：580007）、东吴新产业精选混合型证券投资基金(基金代码：580008）、东吴中证新兴产业指数证券投资基金(基金代码：585001）、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）、东吴增利债券型证券投资基金A(基金代码：582002）、东吴增利债券型证券投资基金C(基金代码：582202）、东吴货币市场证券投资基金A(基金代码：583001）、东吴货币市场证券投资基金B(基金代码：583101）、东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：582003）、东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：580009）、东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：000531）、东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金A(基金代码：001323）、东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：001322）、东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：002159）、东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：002270）、东吴鼎元双债债券型证券投资基金A(基金代码：000958）、东吴鼎元双债债券型证券投资基金C(基金代码：000959）、东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：002561）、东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金(基金代码：002919）、东吴增鑫宝货币市场基金A(基金代码：003588）、东吴增鑫宝货币市场基金B(基金代码：003589）、东吴优益债券型证券投资基金A(基金代码：005144）、东吴优益债券型证券投资基金C(基金代码：005145）、东吴双三角股票型证券投资基金A(基金代码：005209）、东吴双三角股票型证券投资基金C(基金代码：005210）、东吴悦秀纯债债券型证券投资基金A（基金代码：005573）、东吴悦秀纯债债券型证券投资基金C（基金代码：005574）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。

（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：

中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、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、烟台银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、天相投资顾问有限公司、和讯信息科技有限公司、诺亚正行基金销售有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、浙江金观诚基金销售有限公司、宜信普泽投资顾问（北京）有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、北京晟视天下投资管理有限公司、一路财富（北京）信息科技有限公司、北京钱景基金销售有限公司、成都华羿恒信基金销售有限公司、北京加和基金销售有限公司、杭州科地瑞富基金销售有限公司、上海万得基金销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司、上海汇付基金销售有限公司、北京微动利基金销售有限公司、上海基煜基金销售有限公司、大泰金石基金销售有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、奕丰基金销售有限公司、中民财富管理（上海）有限公司、中信期货有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、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、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、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、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、万联证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中信证券（山东）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、东方证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、南京证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、申万宏源（西部）证券有限公司、中泰证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、中航证券有限公司、华福证券有限责任公司、上海华信证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、九州证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、长城国瑞证券有限公司、爱建证券有限责任公司、金惠家保险代理有限公司。

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。

五、基金的名称

本基金名称：东吴行业轮动混合型证券投资基金

六、基金的类型

本基金类型：契约型开放式混合型基金

七、基金的投资目标

本基金为混合型基金，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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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，并确定股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，并对行业类型进行重新分类和调整。基金经理据此对各行业的配置比例进行适当调整，从而降低行业波动风险。如果在宏观经济环境、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类股票中利润增长速度为正，或者利润增长速度虽为负，但呈现加速增长的股票作为本基金的初选股票池。对于D类股票，将被剔除本基金股票池将被剔除本基金股票池，除了具有明确重组方案的以外。

2）根据东吴企业竞争优势评价体系构建基金股票池

本基金根据波特的五种竞争力模型和价值链分析内容、以及企业能力理论和企业资源理论等，构建出独特的东吴企业竞争优势评价体系，来综合评价上市公司的竞争优势和未来成长能力。东吴企业竞争优势评价体系包括五方面内容：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，具体见表1。

表1 东吴企业竞争优势评价体系

竞争优势维度	具体内容	
战略管理优势	公司治理结构	控股股东与上市公司关系（上市公司经营上独立性与控股股东的自律性）
		董事会、监事会的职能及运作效率
	战略决策	企业家精神以及核心管理层团队合作能力
		企业对外部环境的认识程度（对行业竞争动态、行业技术的未来发展认识的明确程度；对新事业领域的关注程度）
		战略规划、实施、调整能力
		企业文化
	组织设计	组织结构及创新能力
		管理制度（内控制度完善程度）
		人员结构和薪酬制度（激励机制的有效性）
技术优势	技术来源的自主性（自有知识产权，还是引进）	
	技术领先；技术壁垒	
	创新能力（新产品开发费用占销售收入比重；技术开发效率）	
市场优势	商誉（拥有世界品牌、中国驰名商标、较高行业知名度）	
	营销渠道及网络	
	市场地位（国内或某地区的行业领导者、提供独特细分市场产品、行业垄断者或竞争寡头；国内、国际市场份额）	
管理运营优势	企业年度经营计划实施能力	
	财务管理能力（应收帐款周转率、存货周转率）	
	成本控制能力（营业费用、管理费用、财务费用、毛利率与利润率比较分析）	
资源及其他附加优势	拥有稀缺、垄断的生产要素资源和社会资源；兼并重组；股东及政府政策扶持；独特盈利模式；企业一体化程度等	

资料来源：东吴基金

评分准则：1）五大优势评分主要依据各大竞争优势具体内容进行。2）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）。3）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。

在初选股票池基础上，本基金根据上市公司竞争优势综合分值，分行业选出竞争优势综合分值最大的前50%作为本基金股票池。

3）本基金股票池的构建

根据东吴企业成长、估值优势识别模型和东吴企业竞争优势评价体系，精选出具有成长优势、估值优势，并具备竞争优势的股票作为本基金股票池。

本基金股票池具体构建流程见图1。

资料来源：东吴基金

3、债券投资策略

本基金采取积极的债券投资管理策略。制定具体投资策略自上而下考虑的因素是：基础利率、债券收益率曲线、市场波动、个券的相对价值和套利可能性。与之相对应，本基金分别采取利率预期策略、骑乘收益率策略、相机抉择策略、相对价值策略和套利交易策略。结合投资策略的制定构造债券组合，分别在子弹式组合、梯式组合和杠铃式组合当中进行选择。在债券品种选择上，本基金遵循相对价值原则和流动性原则。现券的相对价值原则指选择到期收益率处于收益率曲线上方的个券，在到期收益率接近的券种之间，选择久期较短者，在久期接近的券种之间，选择凸性较大者；本基金在品种选择上优先考虑流动性高的个券。

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。

十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准：

本基金整体业绩比较基准=75%★沪深300指数+25%★中证全债指数。

该基金原业绩比较基准“中信标普全债指数”自2015年9月28日变更为“中证全债指数”。更改业绩比较基准的原因是中信标普全债指数停止发布，且更改为中证全债指数的原因是中证全债指数的编制方案以及风险收益情况与中信标普全债指数较相近。

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经与基金托管人协商一致，基金管理人履行相关的程序后，可变更业绩比较基准并及时公告。

十一、基金的风险收益特征

本基金是一只进行主动投资的混合型基金，其风险和预期收益均高于货币市场型基金和债券型基金，低于股票型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益较高的基金产品。

十二、基金的投资组合报告

东吴行业轮动混合型开放式证券投资基金(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。

本基金的托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月22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。

本投资组合报告所载数据截至2018年9月30日（未经审计）。

1、 报告期末基金资产组合情况：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	314,435,554.13	92.53
	其中：股票	314,435,554.13	92.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	24,404,459.04	7.18
8	其他资产	965,527.47	0.28
9	合计	339,805,540.64	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	255,555,470.22	75.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	108,232.20	0.03
F	批发和零售业	17,261,481.09	5.11
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,799,663.00	10.89
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,710,707.62	1.39
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	314,435,554.13	93.05

2.2报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300037	新宙邦	1,060,300	25,054,889.00	7.41
2	300073	当升科技	979,328	24,767,205.12	7.33
3	603799	华友钴业	411,972	21,953,987.88	6.50
4	603986	兆易创新	245,706	21,801,493.38	6.45
5	000977	浪潮信息	800,965	19,287,237.20	5.71
6	300316	晶盛机电	1,637,667	18,407,377.08	5.45
7	300750	宁德时代	234,500	17,118,500.00	5.07
8	600884	杉杉股份	1,021,799	17,064,043.30	5.05
9	300059	东方财富	1,412,560	15,891,300.00	4.70
10	300377	赢时胜	1,185,500	14,759,475.00	4.37

4、报告期末按券种品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细：

本基金本报告期末未持有资产支持证券

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细：

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

1）本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2）本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）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	494,631.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,522.08
5	应收申购款	466,373.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	965,527.47

4）报告期末，持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十三、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。

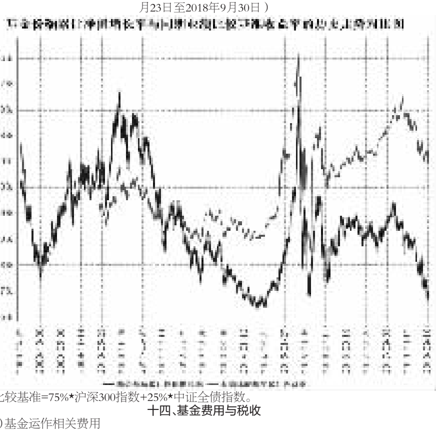
（1）东吴行业轮动基金历史时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	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
2008.04.23-2008.12.31	-26.56%	1.63%	-31.79%	2.31%	5.23%	-0.68%
2009.01.01-2009.12.31	42.10%	1.71%	72.60%	1.54%	-30.50%	0.17%
2010.01.01-2010.12.31	19.05%	1.71%	-8.88%	1.19%	27.93%	0.52%
2011.01.01-2011.12.31	-37.26%	1.66%	-17.81%	0.98%	-19.45%	0.68%
2012.01.01-2012.12.31	-2.86%	1.90%	6.67%	0.96%	-9.53%	0.94%
2013.01.01-2013.12.31	-26.13%	1.70%	-5.29%	1.05%	-20.84%	0.65%
2014.01.01-2014.12.31	23.88%	1.21%	41.10%	0.92%	-17.22%	0.29%
2015.01.01-2015.12.31	32.94%	3.29%	6.10%	1.87%	26.84%	1.42%
2016.01.01-2016.12.31	-9.50%	2.18%	-7.96%	1.05%	-1.54%	1.13%
2017.01.01-2017.12.31	0.15%	1.21%	16.25%	0.48%	-16.10%	0.73%
2018.01.01-2018.09.30	-30.76%	1.84%	-9.57%	0.92%	-21.19%	0.92%
2008.04.23-2018.09.30	-42.19%	1.91%	15.76%	1.27%	-57.95%	0.64%

注：统计截至2018年9月30日，比较基准=75%★沪深300指数+25%★中证全债指数。（该基金原业绩比较基准“中信标普全债指数”自2015年9月28日变更为“中证全债指数”）

（2）东吴行业轮动基金累计净值增长率历史走势图：

自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动进行比较（2008年4月23日至2018年9月30日）



注：比较基准=75%★沪深300指数+25%★中证全债指数。

十四、基金费用与税收

（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、投资交易费用；
4、银行划汇费用；
5、基金信息披露费用；
6、基金份额持有人大会费用；
7、基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；
8、基金销售服务费，具体计提办法按中国证监会的具体规定执行；
9、按照国家有关规定的其他费用。

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

本基金申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”中的“（六）申购费与赎回费”与“（七）申购份数与赎回金额的计算方式”中的相关规定。

本基金转换费率由基金管理人届时另行规定。

（三）基金税收

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。

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》、《公开募集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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，本基金管理人对本基金原招募说明书进行了更新，并根据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

1、在“重要提示”中，对相关内容进行了更新。
2、在“三、基金管理人”中，对相关内容进行了更新。
3、在“四、基金托管人”中，对相关内容进行了更新。
4、在“五、相关服务机构”中，对相关内容进行了更新。
5、在“八、基金份额的申购与赎回”中，对相关内容进行了更新。
6、在“九、与基金管理人管理的其他基金转换”中，对相关内容进行了更新。
7、在“十、基金的投资”中，对相关内容进行了更新。
8、在“十一、基金的业绩”中，对相关内容进行了更新。
9、在“十八、基金的风险揭示”中，对相关内容进行了更新。
10、在“二十三、其他应披露事项”中，更新了其他披露事项。

十六、签署日期

本基金更新招募说明书于2018年12月6日签署。

东吴基金管理有限公司
二零一八年十二月六日

东吴新经济混合型证券投资基金基金经理变更公告

公告送出日期：2018年12月6日

1公告基本信息

基金名称	东吴新经济混合型证券投资基金
基金简称	东吴新经济
基金主代码	580006
基金管理人名称	东吴基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》
基金经理变更类型	解聘基金经理
新任基金经理姓名	一
共同管理本基金的其他基金经理姓名	张能进
离任基金经理姓名	徐嵧

2离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	徐嵧
离任原因	因工作原因
离任日期	2018年12月6日
转任本公司其他工作岗位的说明	一
是否已按规定在中国基金业协会办理变更手续	是
是否已按规定在中国基金业协会办理注销手续	否

3其他需要说明的事项

上述事项已经按规定向中国证券投资基金业协会办理相应手续，并报中国证券监督管理委员会上海监管局备案。

特此公告。

东吴基金管理有限公司
二零一八年十二月六日