东吴保本混合型证券投资基金招募说明书

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

二零一二年七月

【重要提示】

本基金根据【略】年【略】月【略】日中国证券监督管理委员会（以下简称“证监会”）关于同意东吴保本混合型证券投资基金募集的批复【证监基金字【略】【略】】号）的核准，进行募集。

基金管理人保证：东吴保本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。

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、投资组合保险机制的风险等。本基金作为保本混合型基金，属证券投资基金中的较低风险收益品种，但资产配置中将会有最多【略】的基金资产投资于股票市场，基金份额净值会随股票市场的变化而上下波动。

未持有到期、保本周期内申购、保本周期内转换入的投资者，在赎回时不能获得保本保证，将承担市场波动的风险。详见《基金合同》与《招募说明书》中“基金的保本”、“保本的保证”部分。投资者应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）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。

投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

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。

一、绪言

本《招募说明书》依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、其他有关规定及《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《本基金合同》或《基金合同》”）编写。

本《招募说明书》阐述了《东吴保本混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本《招募说明书》。

本基金管理人承诺本《招募说明书》不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金根据本《招募说明书》所载明资料募集。本《招募说明书》由本基金管理人解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人对未在本《招募说明书》中载明的信息、或对本《招募说明书》作出任何解释或者说明。

本招募说明书根据基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。投资者取得依基金合同所发售的基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

基金或本基金：指东吴保本混合型证券投资基金

基金管理人：指东吴基金管理有限公司

基金托管人：指中国农业银行股份有限公司

《基金合同》：指《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

《托管协议》：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《东吴保本混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

《远招募说明书》：指《东吴保本混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

《基金份额发售公告》：指《东吴保本混合型证券投资基金份额发售公告》

《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订

《销售办法》：指中国证监会《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订

《信息披露办法》：指中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订

《运作办法》：指中国证监会《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订

《指导意见》：指《关于保本基金的指导意见》

《中国证监会》：指中国证券监督管理委员会

《银行业监督管理机构》：指中国人民银行和《中国银行业监督管理委员会

《基本合同当事人》：指受基本合同约束，根据基本合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

《个人投资者》：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

《机构投资者》：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

《投资人》：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

《基本金份额持有人》：指根据基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

《销售机构》：指基金管理人或销售机构宣传推介基金、发售基金份额、办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务。

《销售机构》：指东吴基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

《登记业务》：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

《登记机构》：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为东吴基金管理有限公司或接受东吴基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

《基金账户》：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

《基金交易账户》：指登记机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户

《基金份额持有人大会》：指基金管理人或销售机构宣传推介基金、发售基金份额、办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务。

《销售机构》：指东吴基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

《登记业务》：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

《登记机构》：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为东吴基金管理有限公司或接受东吴基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

《基金账户》：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

《基金交易账户》：指登记机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖基金的基金份额变动及结余情况的账户

《基金份额持有人》：指基金基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

基金或本基金：指东吴保本混合型证券投资基金

基金管理人：指东吴基金管理有限公司

基金托管人：指中国农业银行股份有限公司

《基金合同》：指《东吴保本混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

《托管协议》：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《东吴保本混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

《远招募说明书》：指《东吴保本混合型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新

《基金份额发售公告》：指《东吴保本混合型证券投资基金份额发售公告》

《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订

《销售办法》：指中国证监会《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订

《信息披露办法》：指中国证监会《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订

《运作办法》：指中国证监会《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订

《指导意见》：指《关于保本基金的指导意见》

《中国证监会》：指中国证券监督管理委员会

《银行业监督管理机构》：指中国人民银行和《中国银行业监督管理委员会

《基本合同当事人》：指受基本合同约束，根据基本合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

《个人投资者》：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

《机构投资者》：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

《合格境外机构投资者》：指经中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

《基本金份额持有人》：指根据基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

《销售机构