东吴优信稳健债券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:中国建设银行股份有限公司

重要提示

本基金根据2008年8月15日中国证券监督管理委员会《关于核准东吴优信稳健债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可【2008】1048号)的核准,进行募集。2008 年11月05日得到中国证监会书面确认,基金备案手续办理完毕,基金合同自该日起正式生效。

基金管理人保证《东吴优信稳健债券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2015年11月5日,有关财务数据及净值表现截止日为2015年9月30日(财务数据未经审计)。

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》")、《公开募集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《东吴优信稳健债券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。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读招募说明书。

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】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:钱巍
10.电话:(021)50509888
11.传真:(021)50509884
12.客户服务电话:400-821-0588(免长途话费)、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	7000	70%
上海兰生(集团)有限公司	3000	30%
合 计	10,000	100%

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	7000	70%
上海兰生(集团)有限公司	3000	30%
合 计	10,000	100%

15.简要情况介绍:

东吴基金管理有限公司设立基金投资总部、专户业务事业部、研究策划部、集中交易室、营销管理部、北京营销中心、上海营销中心、广州营销中心、苏州分公司、产品策略部、营销策划部(加挂电子金融部)、总经理办公室、人力资源部、基金事务部、信息技术部、财务管理部、监察稽核部、风险管理部、北京办事处等19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混合型型证券投资基金,于2006年12月15日基金合同生效,托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第三只产品东吴行业轮动混合型证券投资基金,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混合型证券投资基金,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混合型证券投资基金,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。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混合型证券投资基金,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(LOF),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配置优化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。公司已管理的第十四只产品东吴内需增长混合型证券投资基金,于2013年1月30日基金合同生效,托管行为交通银行股份有限公司。公司已管理的第十五只产品东吴鼎利分级债券型证券投资基金,于2013年4月25日基金合同生效,托管行为交通银行股份有限公司。公司已管理的第十六只产品东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金,于2014年3月19日基金合同生效,托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第十七只产品东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金,于2014年5月9日基金合同生效,托管行为平安银行股份有限公司。公司已管理的第十八只产品东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金,于2015年5月27日基金合同生效,托管行为平安银行股份有限公司。公司已管理的第十九只产品东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金,于2015年7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

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,东吴证券股份有限公司董事长、党委书记,现任东吴基金管理有限公司董事长。

陈辉峰先生,副董事长,大学,高级国际商务师,中共党员。历任上海轻工国际(集团)有限公司五金分公司总经理、上海轻工国际发展有限公司副总经理、上海兰生股份有限公司常务副总经理、总经理、上海兰生(集团)有限公司营运管理部总经理。现任上海东浩兰生国际服务贸易(集团)有限公司投资发展部总经理。

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,东吴证券股份有限公司资产管理总部总经理、总经济师、总裁助理兼托管期货筹备组组长、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。

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、总裁助理兼经营总部总经理、副总裁,东吴证券总规划师兼研究所所长,现任东吴证券股份有限公司总规划师兼资产管理总部总经理。

全卓伟女士,董事,硕士研究生,历任上海市国有资产监督管理委员会综合处、规划发展处副主任科员、主任科员,企业改革处副处长。现任上海东浩兰生国际服务贸易(集团)有限公司资本运营部副总经理、上海东浩资产经营有限公司副总经理。

王炯先生,职工董事,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。现任东吴基金管理有限公司常务副总经理。

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财经学院讲师、副教授。现任苏州大学商学院财经学院教授。

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。

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

顾锡康先生,监事会主席,硕士学位,高级工程师、经济师,中共党员。历任苏州电子计算机厂工程师、室主任,苏州人民银行科技科硬件组组长,苏州证券电脑中心经理、技术总监,东吴证券技术总监兼信息技术总部总经理,东吴证券股份有限公司合规总监、监事会主席。

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总经理。

沈清韵,员工监事,本科,学士学位,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,现任监察稽核部总经理兼风险管理部总经理。

3.高级管理人员

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。(简历请参见上述董事会成员介绍)
王炯先生,常务副总经理。(简历请参见上述董事会成员介绍)

徐军女士,督察长,大学,会计师、审计师,中共党员。历任苏州市审计局财政、金融审计处科员、副处长,东吴证券财务部总经理,东吴基金管理有限公司财务负责人、总裁助理等职务,现任东吴基金管理有限公司督察长。

4.基金经理

杨庆定,博士,上海交通大学管理学专业毕业。历任大公国际资信评估有限责任公司上海分公司研究员与结构融资部总经理、上海证券有限责任公司高级经理、太平资产管理有限公司高级投资经理;2007年7月至2010年6月期间任东吴基金管理有限公司研究员、基金经理助理;2013年4月再次加入东吴基金管理有限公司,现任固定收益部总经理,其中自 2013年6月25日起任东吴鼎利分级债券型证券投资基金基金经理、自2014年5月9日起任东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金、自2014年6月28日起任东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理、自2014年6月28日起任东吴配置优化混合型证券投资基金基金经理。

历任基金经理:徐嵩先生,历任平安信托投资责任有限公司资产管理部交易员,平安保险资产营运中心银行间交易员,上投摩根基金管理有限公司基金经理助理。2008年11月5日至2011年10月14日担任东吴优信基金经理。

历任基金经理:韦勇先生,香港公开大学MBA毕业,曾任贵州证券有限责任公司交易经理、汉唐证券有限责任公司投资经理、恒泰证券股份有限公司投资经理等职;2009年6月加入东吴基金管理有限公司,其中于2009年12月23日至2011年10月14日担任东吴优信稳健基金经理。

历任基金经理:丁蕙同志,香港大学工商管理硕士,15年从业经历,历任中信证券上海营业部交易员,汉唐证券固定收益部债券研究主管,航天科技财务公司债券投资主管,平安资产管理公司投资经理;2011年7月加入东吴基金管理有限公司,曾担任公司固定收益部总经理,其中自 2011年09月28日起至2014年6月28日担任东吴优信稳健债券基金基金经理。

5.投资决策委员会成员

任少华　公司总经理;
杨庆定　基金投资总部总经理;
陈　宪　研究策划部总经理;
戴　斌　基金投资总部副总经理;
王立立　基金投资总部副总经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

1、基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所: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
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田　青
联系电话:(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月,是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行,总部设在北京。中国建设银行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2015年6月末,本集团资产总额182,192亿元,较上年末增长8.81%;客户贷款和垫款总额101,571亿元,增长7.20%;客户存款总额136,970亿元,增长6.19%。净利润1,322亿元,同比增长0.97%;营业收入3,110亿元,同比增长8.34%,其中,利息净收入同比增长6.31%,手续费及佣金净收入同比增长5.76%。成本收入比23.23%,同比下降0.94个百分点。资本充足率14.70%,处于同业领先地位。

物理与电子渠道协同发展。总行成立了渠道与运营管理部,全面推进渠道整合;营业网点"三综合"建设取得新进展,综合性网点达到1.44万个,综合营销团队达到19,934个,综合柜员占比达到84%,客户可在转型网点享受便捷舒适的"一站式"服务。加快打造电子银行的主渠道建设,有力支持物理渠道的综合化转型,电子银行和自助渠道账务性交易量占比达94.32%,较上年末提高6.29个百分点;个人网上银行客户、企业网上银行客户、手机银行客户分别增长8.19%、10.78%和11.47%;善融商务推出精品移动平台,个人商城手机客户端"建行善融商城"正式上线。

转型重点业务快速发展。2015年6月末,累计承销非金融企业债务融资工具2,374.76亿元,承销金额继续保持同业第一;证券投资基金托管只数和新发基金托管只数均列市场第一,成为首批香港基金内地销售代理人中唯一一家银行代理人;多模式现金池、票据池、银联单位结算卡等战略性产品市场份额不断扩大,现金管理品牌"禹道"的市场影响力持续提升;代理中央财政授权支付业务、代理中央非税收入收缴业务客户数保持同业第一,在同业中首家按照财政部要求实现中央非税收入收缴电子化上线试点。"鑫存管"证券客户保证金第三方存管客户数3,076万户,管理资金总额7,417.41亿元,均为行业第一。

2015年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与业界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的40多项重要奖项。在英国《银行家》杂志2015年"世界银行1000强排名"中,以一级资本总额继续位列全球第2;在美国《福布斯》杂志2015年全球上市公司2000强排名中继续位列第2;在美国《财富》杂志2015年世界500强排名第29位,较上年上升9位;荣获美国《环球金融》杂志颁发的"2015年中国最佳银行"奖项;荣获中国银行业协会授予的"年度最具社会责任金融机构奖"和"年度社会责任最佳民生金融奖"两个综合大奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工210余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二)主要人员情况

赵观甫,投资托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作,并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务,长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部,并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2015年9月末,中国建设银行已托管537只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为"中国最佳托管银行"。

二、基金托管人的内部控制制度

(一)内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,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。

(二)内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行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。投资托管业务部专门设置了监督稽核处,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。

(三)内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、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;业务管理严格实行复核、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

(一)监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的"托管业务综合系统——基金监督子系统",严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

(二)监督流程

1.每工作日按时通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

3.根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价,报送中国证监会。

4.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

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:任少华
联系人:钱巍
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:杨菲
传真:(010)66105662
客服电话:95588
公司网址:www.icbc.com.cn

(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
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
联系人:郭伟
电话:010-65557048
传真:010-65550827
客服电话:95558
公司网址:http://bank.ecitic.com

(3)中国农业银行股份公司
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:刘峰
电话:(010)85108226
传真:(010)85109219
客服电话:95599
公司网址:www.abchina.com

(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:牛锡明
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)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:杨成茜
电话:(010)57092619
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

(10)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

(11)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:张莉
电话:021-38637673
客服电话:40066-99999(免长途费)0755-961202
公司网址:www.pingan.com

(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
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

(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
联系人:王淑华
电话:0535-6699660
传真:0535-6699884
客服电话:4008-311-777
公司网址:www.yantaibank.net

(14)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
办公地址:苏州工业园区星阳街5号
法定代表人:范力
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

(15)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

(16)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:陈有安
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

(17)申万宏源证券股份有限公司
注册地址:上海徐汇区长乐路989号45层
办公地址:上海徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
联系人:黄莹
电话:021-33389888
传真:021-33388224
客服电话:95523或4008895523
公司网址:www.swhysc.com

(18)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

(19)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
联系人:黄岚
电话:020-87555888
传真:020-87555305
客服电话:95575或致电各地营业网点
公司网址:www.gf.com.cn

(20)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

(21)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

(22)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

(23)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

(24)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

(25)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:021-38676161
传真:021-38670161
客户服务热线:400-8888-666

(26)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:方文
电话:0755-83199599
传真:0755-83199545
客服电话:0755-83199511
公司网址:www.csco.com.cn

(27) 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

(28)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:胡月茹
电话:021-63325888
传真:021-63326173
客服电话:021-962506
公司网址:www.dfzq.com.cn

(29)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: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

(30)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:025-83290523
传真:025-84579763
联系人:肖亦玲
客服电话:95597
公司网址:www.htsc.com.cn

(31) 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

(32)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

(33)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222号青岛国际金融广场1号楼第20层
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:杨宝林
电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
联系人:吴忠超
客服电话: 95548
公司网址: www.citicssd.com

(34)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:薛峰
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

(35)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

(36)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
客户服务电话:4006208888
公司网址:www.bocichina.com

(37)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

(38)中泰证券有限公司
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

(39)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

(40) 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

(41)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

(42)东海证券有限责任公司
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:刘化军?
电话:021-20333333
传真:021-50498825
联系人:梁旭
客服电话:95531;400-8888-588?
网址:www.longone.com.cn?

(43)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.china-invs.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:宫龙云
联系人:戴莉丽
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　邮编:100032
办公地址: 北京市西城区新街口外大街28号C座5层　邮编:100088
法定代表人:林义相
联系人:尹伶
联系电话:010-66045529
客服电话: 010-66045678
传真: 010-66045518
天相投顾网址: http://www.txsec.com
天相基金网网址:www.jjm.com.cn

(46)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:宋歌
电话:021-68778081
传真:021-68778117
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
联系人:吴琼
电话:0755 - 22621866
传真:0755 - 82400862
客服热线:95511-8
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:杨泽柱
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

(50)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
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

(51)华安证券有限责任公司
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号财智中心B1座
法定代表人:李工
联系人:甘霖
电话:0551-65161821
传真:0551-65161672
客服电话:0551-96518或者4008096518
公司网址:www.hazq.com

(52)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:021-53303353
客服电话:4008918918
公司网址:www.shzq.com

(53)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
联系人: 林洁茹
电话:020-88836999
传真:020-88836654
客服电话:020-961303
公司网址:www.gzs.com.cn

(54)长城国瑞证券有限公司
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: 王勇
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

(55) 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

(56) 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
联系人: 赖君伟
电话:0755-23902400
传真:0755-82545500
客服热线:40018-40028
公司网址:www.wkzq.com.cn

(57)九州证券经纪有限公司
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:聂晗
电话:0755-33331188
传真:0755-33329815
客服热线:4006543218
公司网址:www.tyzq.com.cn

(58)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
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:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层
办公地址:浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22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

(60)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I、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I、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

(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: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

(62)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:牛孟宇
电话:0755-83709350
传真:0755-83704850
客服热线:95563
公司网址:www.ghzq.com.cn

(63)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: 浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人: 凌顺平
联系人: 杨翼
电话:0571-88911818转8565
传真:0571—86800423
客服热线:4008-773-772
公司网址:www. 5ifund.com

(64)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

(65)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:上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法定代表人:其实
联系人:潘世友
电话:021-54509998
传真:021-64385308
客服热线:400-1818-188
公司网址:www.1234567.com.cn

(66)杭州数米基金销售有限公司
注册地址: 杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人: 陈柏青
联系人: 张裕
电话:021-60897840
传真:0571-26698533
客服热线:4000 766 123
公司网址:www.fund123.cn

(67)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号泛利大厦10层
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
联系人:于杨
电话:021-20835779
传真:021-20835885
客服热线:400-920-0022
公司网址:http://licaike.hexun.com/

(68)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:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
联系人:敖玲
电话:021-58788678-8201
传真:021—58787698
客服电话:400-089-1289
公司网站: www.erichfund.com

(69)万联证券有限责任公司
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
联系人: 王鑫
电话:020-38286588
传真:020-38286588
客服热线:4008888133
公司网址:www.wlzq.com.cn

(70) 苏州银行股份有限公司
注册地址:江苏省苏州市东吴北路143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
联系人:项喻楠
电话:0512-69868389
传真:0512-69868370
客服热线:96067
公司网址:www.suzhoubank.com

(71)江苏银行股份有限公司
注册地址:江苏省南京市洪武北路55号
办公地址:江苏省南京市洪武北路55号
法定代表人:夏平
联系人:朱其龙
电话:86-25-58587112
传真:86-25-58588273
客服热线:40086-96098
公司网址:www.jsbchina.cn

(72)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
联系人: 刘婧漪
电话:028-86690057
传真:028-86690126
客服热线:4006600109
公司网址:www.gjzq.com.cn

(73)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
联系人: 张茹
电话:021-20613999
传真:021-68596916
客服热线:400-700-9665
公司网址:www.ehowbuy.com

(74)上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
办公地址:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人:冯修敏
联系人:陈云卉
电话:021-33323999
传真:021-333323830
客服热线:4008202819
公司网址:http://www.chinapnr.com/

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:任少华
联系人:钱巍
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: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(特殊普通合伙)
注册地址:南京市建邺区江东中路106号万达广场商务楼B座(14幢)20楼
办公地址:南京市建邺区江东中路106号万达广场商务楼B座(14幢)20楼
法定代表人:余瑞玉
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:东吴优信稳健债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式债券型基金

六、基金的投资目标

本基金属于债券型基金,在控制风险和保持资产流动性的前提下,精选高信用等级债券,通过主动式管理及量化分析追求稳健、较高的投资收益。

七、基金的投资范围

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、信用等级较高的企业债、公司债、次级债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、回购、央行票据、资产支持证券等,以及部分股票、权证等权益类品种和法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。本基金投资于债券类资产(包括含权债券)的比例不低于基金资产净值的80%,投资于一级市场新股申购、持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票等中国证监会允许基金投资的其它金融工具比例合计不超过基金资产净值的20%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

对于中国证监会允许投资的创新类金融产品,将依据有关法律法规进行投资管理。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,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

本基金是一只债券型基金,以债券投资为主,股票投资为辅原则构建和管理投资组合。对于债券投资,本基金通过对利率走势的判断和债券收益率曲线变动趋势的分析,确定本基金债券组合久期和期限结构配置。债券选择上,本基金根据债券信用风险特征、到期收益率、信用利差和税收差异等因素的分析,并考虑债券流动性和操作策略,选择投资价值高的债券作为本基金的投资对象。本基金股票投资是作为债券投资的有益补充,主要采取自下而上的策略精选具有估值优势的优势企业股票作为投资对象。

(一)债券投资策略

1、利率分析和债券组合久期确定

利率是债券投资重要影响因素,本基金将通过宏观经济和政策取向的分析,把握利率走势,为债券投资决策提供依据。

从理论与实践经验看,影响利率走势的因素主要有:1、宏观经济增长状况,主要衡量指标有GDP增速、工业增加值、固定资产投资增速、消费水平、贸易顺差程度;2、物价走势:CPI、PPI;3、货币供应量和信贷增速;4、国际主要经济体利率走势。本基金通过以上四个方面的综合分析,把握利率走势。

根据利率走势的判断结果,确定债券投资组合久期。在预期利率下降时,增加债券组合久期,提高债券价格上涨产生的收益;在预期利率上升时,减小债券组合久期,降低债券价格下跌产生的损失。

2、期限结构配置策略

本基金在确定债券组合久期之后,将结合收益率曲线变化的预测,通过分析和情景测试,确定短、中、长期三类债券的投资比例。具体而言:

通过考察市场收益率曲线的历史变动情况,并结合利率走势,把握收益率曲线变化趋势。在此基础上,本基金根据收益率曲线变动特征,在子弹式组合、梯式组合和杠铃式组合当中进行选择期限结构配置策略,据此确定本基金债券组合在短、中、长期三类不同期限结构的配置。

3、债券选择策略

在债券选择上,本基金,首先精选信用风险低的债券构建初选债券池。其次,选择投资价值高的债券作为本基金的投资对象。

1)债券信用风险评级

随着我国债券市场的发展,具有信用风险的债券品种扩展迅速,并且银监会近期要求银行系统退出债券担保市场,进一步凸显了我国债券市场信用风险。与此同时,根据国内外债券市场经验表明,信用风险(如美国次级债危机)会造成债券投资重大损失。在信用风险逐步凸显的背景下,本基金为控制投资风险,参考其它信用评级机构对债券信用风险评级结果,同时结合东吴基金债券信用风险评级体系得出的评级结果,确定债券最终信用评级等级。本基金选择中长期债券不低于AA、短期债券不低于A-1(或相应的信用级别),同时纳入全部无信用风险债券,作为本基金初选债券池。东吴基金债券信用风险评级体系借鉴国内外信用评级机构的评级方法,从企业现金流与债务匹配的角度把握企业信用状况。

2)债券投资价值分析

在初选债券池基础上,本基金根据东吴基金债券投资价值分析体系,选择投资价值高的债券作为本基金的投资对象。东吴基金债券投资价值分析体系根据债券到期收益率、信用利差和税收差异等因素的分析,并考虑债券流动性溢价和操作策略进行构建的。具体做法是:

首先,计算各债券到期收益率;其次,计算剔除税率的到期收益率;第三,考虑信用利差的到期收益率。根据以上经税收和信用利差修正后的到期收益率大小,本基金对债券投资价值从大到小排序。第四,根据各债券流动性溢价水平,以及债券操作策略(如果采取买入持有操作策略,可以不考虑流动性问题),对以上债券投资价值排序进行优化,选择投资价值高的债券构建本基金债券投资组合。

(二)股票投资策略

本基金的股票投资作为债券投资的有益补充,以提高投资组合收益并适当分散风险。对于股票投资策略,本基金采取自下而上策略,精选具有估值优势的优势企业股票作为投资对象。本基金优势企业是指具有明显竞争优势,并且未来能够实现持续增长。具体选股步骤是:

首先,本基金充分利用本基金管理人行业研究员的盈利预测数据,并结合国内研究机构做过盈利预测数据的上市公司,初步筛选出未来两年净利润复合增长率超过20%的上市公司的股票,作为 "备选股票池(Ⅰ)"。

其次,在"备选股票池(Ⅰ)"基础上,根据东吴基金企业竞争优势评价体系精选具有竞争优势的上市公司股票作为"备选股票池(Ⅱ)"。东吴基金企业竞争优势评价体系是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的,用来评价上市公司的竞争优势和未来成长能力。东吴基金企业竞争优势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。行业研究员对不同竞争优势进行打分,并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。最后,精选竞争优势综合分值排名最靠前的上市公司股票作为"备选股票池(Ⅱ)"。

第三,本基金根据内在价值和相对价值相结合的估值方法评估"备选股票池(Ⅱ)"股票的投资价值,其中内在价值采取现金流贴现估值方法,相对价值评估主要采取PE、PB和PEG等指标。最后精选出"备选股票池(Ⅱ)"中具有投资价值的股票作为本基金投资对象。

(三)新股申购策略

从我国未来证券市场的发展来看,新股发行仍然会保持一定的数量与规模,在目前的政策条件下,由于一、二级市场价差的存在,参与新股申购能够取得较高的固定收益。通过对过往新股发行上市的数据分析,我们发现,申购新股可获得股票市场无风险的固定收益。

本基金作为固定收益类产品,为获得目前股票市场存在的固定收益,将在充分研究新发股票基本面的前提下,参与新股的申购。

(四)投资决策流程

本基金具有严密科学的投资决策流程和明确的分级授权体系,具体如下:

1、投资决策委员会:决策基金总体战略、资产配置、审议基金的债券(股票)池、对基金经理提出的仓位与组合预案进行审议与决策,就风险事项与风险管理委员会沟通;

2、基金经理:参与构建基金的债券(股票)池、提出资产配置方案、实施具体投资计划。基金经理必须严格按照《投资管理流程》进行操作,资产配置方案经投资决策委员会审议通过后,以《资产配置方案决议》的形式形成书面结果,作为基金经理投资操作的依据,同时给投资总监、风险控制部门等备案,以便监控。

3、集中交易室:执行基金经理的交易指令、反馈交易指令的执行情况、监督交易指令的合规合法性;

4、研究平台:构建债券(股票)池、为投资决策委员会提供投资决策咨询支持、为基金经理投资提供支持;

5、金融工程小组:通过对投资组合的跟踪与评估,为投资决策委员会和基金经理提供投资实际效果的反馈意见,以优化改进投资决策;

6、风险控制部门:由风险管理委员会、监察稽核部、风险管理部等构成。监察稽核部对投资决策及实际投资进行稽查,并定期和不定期向风险管理委员会提供相关报告;风险管理部定期评估投资组合风险与收益水平,向风险管理委员会提供投资组合风险评估报告。风险管理委员会就风险事项和风险评估报告进行审议并与投资决策委员会沟通,以监控投资决策流程和各级决策权限的行使是否合法合规及科学合理。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中证全债指数。

本基金债券投资比例为80%-100%,根据相关法律法规定义,本基金为债券型基金。由于本基金股票投资只是作为债券投资的有益补充,比例相对较低,所以基金基准里就不考虑股票部分。由于本基金债券投资范围不仅包括国债,而且也包括企业债和金融债等,中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,能够反应本基金对债券配置的业绩。

若未来市场发生变化导致此业绩基准不再适用, 基金管理人可根据市场变化情况及本基金的投资范围和投资策略,调整该基金的业绩比较基准。业绩基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致,并在更新的招募说明书中列示。

十、基金的风险收益特征

本基金主要投资于高信用级别、投资价值高的债券资产,属证券投资基金中的低风险品种,长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。

十一、基金的投资组合报告

东吴优信稳健债券型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。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月21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2015年9月30日(未经审计)

1、截至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	207,600.00	0.53
	其中:股票	207,600.00	0.53
2	固定收益投资	36,020,432.45	92.18
	其中:债券	36,020,432.45	92.18
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,219,486.43	5.68
7	其他资产	626,813.93	1.60
8	合计	39,074,332.81	100.00

2、截至报告期末按行业分类的股票投资组合。

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	207,600.00	0.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
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	-	-
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	207,600.00	0.72

3、截至报告期末,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	300186	大华农	6,000	207,600.00	0.72

4、截至报告期末,按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,461,606.00	5.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	34,558,826.45	119.21
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	36,020,432.45	124.25

5、截至报告期末,按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	124352	13平凉债	100,000	10,500,000.00	36.22
2	122157	12广控01	50,000	5,184,000.00	17.88
3	122125	11美兰债	39,980	4,377,410.20	15.10
4	112076	12雅致02	25,000	2,636,000.00	9.09
5	112163	12黑牛01	19,790	1,962,772.20	6.77

6、截至报告期末,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。

7、截至报告期末,按公允价值占基金资产净值比例大小排名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、截至报告期末,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。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1) 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未持有国债期货。
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。
3)本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未持有国债期货。

10、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)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)截至报告期末,其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	29,511.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	597,302.60
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	626,813.93

4)截至报告期末,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)截至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)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.东吴优信稳健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

1)东吴优信稳健债券基金A

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
2008.11.05-2008.12.31	2.44%	0.17%	2.25%	0.11%	0.19%	0.06%
2009.01.01-2009.12.31	0.27%	0.20%	0.27%	0.06%	0.00%	0.14%
2010.01.01-2010.12.31	3.58%	0.37%	2.00%	0.07%	1.58%	0.30%
2011.01.01-2011.12.31	-8.93%	0.34%	3.79%	0.06%	-12.72%	0.28%
2012.01.01-2012.12.31	7.81%	0.13%	4.03%	0.04%	3.78%	0.09%
2013.01.01-2013.12.31	-4.18%	0.18%	1.78%	0.05%	-5.96%	0.13%
2014.01.01-2014.12.31	14.96%	0.26%	9.41%	0.16%	5.55%	0.10%
2015.01.01-2015.09.30	1.33%	0.50%	3.68%	0.07%	-2.35%	0.43%
2008.11.05-2015.09.30	16.60%	0.30%	30.35%	0.08%	-13.75%	0.22%

注:1. 统计截至2015年9月30日,比较基准=中证全债指数。
2. 本基金于2009年6月15日开始分为A、C两类

2)东吴优信稳健债券基金C

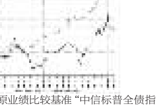
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差%④	①-③	②-④
2009.06.15-2009.12.31	0.28%	0.24%	-0.19%	0.05%	0.47%	0.19%
2010.01.01-2010.12.31	3.14%	0.37%	2.00%	0.07%	1.14%	0.30%
2011.01.01-2011.12.31	-9.19%	0.34%	3.79%	0.06%	-12.98%	0.28%
2012.01.01-2012.12.31	7.45%	0.13%	4.03%	0.04%	3.42%	0.09%
2013.01.01-2013.12.31	-4.62%	0.18%	1.78%	0.05%	-6.40%	0.13%
2014.01.01-2014.12.31	14.47%	0.26%	9.41%	0.16%	5.06%	0.10%
2015.01.01-2015.09.30	1.11%	0.50%	3.68%	0.07%	-2.57%	0.43%
2009.06.15-2015.09.30	11.42%	0.31%	26.91%	0.08%	-15.49%	0.23%

注:1. 统计截至2015年9月30日,比较基准=中证全债指数。
2. 本基金于2009年6月15日开始分为A、C两类

2. 东吴优信稳健债券基金累计净值增长率历史走势图

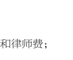
1)自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较(2008年11月05日至2015年9月30日)

东吴优信稳健债券型证券投资基金A



2)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(2009年06月15日至2015年9月30日)

东吴优信稳健债券型证券投资基金C



注:1、比较基准=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、经中国证监会批准,本基金于2009年6月15日开始分为A、C两类。

十三、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.销售服务费
4.基金财产拨划支付的银行费用;
5.基金合同生效后的基金信息披露费用;
6.基金份额持有人大会费用;
7.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
8.基金的证券交易费用;
9.在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明;
10.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定, 法律法规另有规定时从其规定。

(二)与基金运作有关的费用

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0.65%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0.2%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.销售服务费

本基金的A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额计提的销售服务费年费率为0.4%。基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整对C类各级基金份额计提的销售服务费率。销售服务费将专门用于本基金C类基金市场推广、销售以及为C类基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

在通常情况下,销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下:
H=E×销售服务费率÷当年天数
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,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注册登记机构,由基金管理人分别支付给各基金销售机构。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

4.除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关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。

(三)与基金销售有关的费用

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费的,称为A类;不收取认购或申购费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类。

1、东吴优信稳健债券型证券投资基金A类收费模式

基金代码:前端(A类):582001

费用种类	申购金额M	
前端申购费	M<100万	0.8%
	100万≤M<300万	0.5%
	300万≤M<500万	0.25%
	500万≤M	固定费用1000元
费用种类	持有年限Y	
赎回费	Y<1年	0.1%
	1年≤Y<2年	0.05%
	2年≤Y	0%

2、东吴优信稳健债券型证券投资基金C类收费模式

基金代码:582201

费用种类	费率
申购费率	0%
销售服务费(年)	0.4%(每日从基金资产计提)

费用种类	持有年限Y	
赎回费	Y<30天	0.1%
	Y ≥30天	0%

3、本基金赎回费由赎回人承担,在投资者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,其余用于支付登记结算费、销售手续费等各项费用。

5、转换费用

(1)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前端收费(基金代码:580002)、东吴行业轮动混合型证券投资基金(基金代码:580003)、东吴进取策略灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:580005)、东吴新经济混合型证券投资基金(基金代码:580006)、东吴新创业混合型证券投资基金(基金代码:580007)、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)、东吴中证新兴产业指数证券投资基金(基金代码:585001)、东吴新产业精选混合型证券投资基金(基金代码:580008)、东吴配置优化混合型证券投资基金(基金代码:582003)、东吴增利债券型证券投资基金A类(基金代码:582002)、东吴增利债券型证券投资基金C类(基金代码:582202)、东吴内需增长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)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)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(仅限优信A类转换)、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司 、华夏银行股份有限公司、招商银行股份有限公司(仅限优信A类转换)、中国民生银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行有限责任公司、平安银行股份有限公司、温州银行股份有限公司、烟台银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、东吴证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、中信建投证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、东方证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中航证券有限公司、财富证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司(仅限优信A类转换)、招商证券股份有限公司、中泰证券有限公司、恒泰证券股份有限公司、南京证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、华宝证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、厦门证券有限公司、中信证券股份有限公司、九州证券经纪有限公司、上海华信证券有限责任公司、中信证券(浙江)有限责任公司、深圳众禄基金销售有限公司、华鑫证券有限责任公司、国海证券股份有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司、上海天天基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、中信银行股份有限公司、和讯信息科技有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、万联证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、五矿证券有限公司,好买基金销售有限公司,上海汇付金融服务有限公司。

(3)基金转换费用由转出基金的赎回费和转出与转入基金的申购费补差两部分构成,具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

转换公式如下:

1)转出金额=转出基金份额×转出基金T日基金份额净值(此处的T日指基金转换申请日,下同)
2)转出赎回费=转出金额×转出基金赎回费率　(注:转出赎回费的 25% 将归入转出方基金的基金财产)
3)转入金额=转出金额-转出赎回费
4)如果,转出基金的申购费率< 转入基金的申购费率,
申购补差费率=转入基金的申购费率-转出基金的申购费率
申购补差费=转入金额×申购补差费率/(1+申购补差费率)
转入净额=转入金额-申购补差费
如果,转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率,
转入净额=转入金额
5)转入份额=转入净额÷转入基金T日基金份额净值

其中,转入基金的申购费率和转出基金的申购费率均以转出金额为确定依据。

(4)转出金额、转出基金转换费的计算保留小数点后两位,第三位四舍五入,由此产生的误差在转出基金资产中列支;转入份额、申购补差费的计算保留小数点后两位,第三位四舍五入,由此产生的误差在转入基金资产中列支。

(5)对于实行级差申购费率(不同申购金额对应不同申购费率)的基金,以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用;如转入总金额对应转出基金申购费或转入基金申购费为固定费用时,申购补差费用视为0。

(6)计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、更新的招募说明书规定费率执行,对于通过基金管理人网上交易、费率优惠活动期间发生的基金转换业务,按照基金管理人最新公告的相关费率计算基金转换费用。

(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。基金合同生效前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。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

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》、《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》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进行了介绍,并对主要人员情况等内容进行了更新。
3、在"四、基金托管人"中,更新了托管人相关信息。
4、在"五、相关服务机构"中,增加并更新了部分代销机构的情况。
5、在"九、与基金管理人管理的其他基金转换"中,对本基金与本基金管理人管理的其他基金间的转换情况进行了更新。
6、在"十、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2015年9月30日。
7、在"十一、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2015年9月30日。
8、在"二十三、其他应披露事项"中,更新了其他披露事项:

(1)2015年05月29日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、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部分基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行、手机银行申购费率优惠的公告》;

(2)2015年06月08日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、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部分基金在公司网上交易开展转换费率优惠活动的公告》;

(3)2015年06月08日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、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部分基金新增诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及参加柜台、网上交易申购费率优惠的公告》;

(4)2015年06月12日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、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上海好买基金销售有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告》;

(5)2015年06月12日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、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上海好买基金销售有限公司申购费率及定投申购费率优惠的公告》;

(6)2015年06月18日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴优信稳健型证券投资基金招募说明书以及摘要更新》;

(7)2015年06月26日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《关于东吴基金管理有限公司旗下基金参与深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告》;

(8)2015年06月26日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、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数米基金网费率优惠活动的公告》;

(9)2015年06月26日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、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浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告》;

(10)2015年06月29日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、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交通银行股份有限公司网上银行、手机银行延长基金申购费率优惠的公告》;

(11)2015年07月01日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司管理的基金2015年半年度资产净值公告》;

(12)2015年07月07日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、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部分基金在公司直销柜台开展申购费率优惠活动的公告》;

(13)2015年07月07日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于公司及高管、基金经理投资旗下基金相关事宜公告》;

(14)2015年07月21日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴优信稳健债券型证券投资基金2015年第2季度报告》;

(15)2015年08月25日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、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天天基金网费率优惠的公告》;

(16)2015年08月27日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴优信稳健债券型证券投资基金2015年半年度报告以及摘要》;

(17)2015年09月17日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、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上海汇付金融服务有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告》;

(18)2015年09月17日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、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上海汇付金融服务有限公司申购费率及定投申购费率优惠的公告》;

(19)2015年09月24日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、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好买基金网费率优惠的公告》;

(20)2015年09月28日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金关于变更旗下部分开放式基金业绩比较基准并修订基金合同相应条款的公告》;

(21)2015年10月20日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、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部分基金参加平安证券有限责任公司基金申购及定期定额投资费率优惠的公告》;

(22)2015年10月26日在中国证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴优信稳健债券型证券投资基金2015年第3季度报告》;

(23)2015年11月05日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、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上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠的公告》;

东吴基金管理有限公司
二零一五年十二月十八日