东吴新趋势价值线灵活配置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:中国农业银行股份有限公司

【重要提示】

本基金根据【2015】年【4】月【29】日中国证券监督管理委员会《关于准予东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监基金字【2015】【764】号)的注册募集。本基金的基金合同于2015年7月1日正式生效。

基金管理人保证《东吴新趋势价值线灵活配置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》经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,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,由于基金投资者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,基金运作风险等等。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。

本基金投资中小企业私募债券,中小企业私募债券存在较高的流动性风险和信用风险。尽管本基金将中小企业私募债券的投资比例控制在一定范围内,但仍然提请投资者关注中小企业私募债存在的上述风险及其对基金总体风险的影响。

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》。

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。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。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。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2016年1月1日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31日(财务数据未经审计)。

特别提示:

1、提醒投资人正确理解价值线

(1)价值线与基金份额净值是两个不同的概念

开放式基金的基金份额净值是投资人申购、赎回基金份额时的计价基础,而价值线则是基金管理人为约束自身的投资风险,而自设的一个风险控制目标。价值线不是实际的基金份额净值,只是基金管理人力争保证的价值水平。

(2) 价值线不是保底收益承诺

价值线既不是基金投资人的实际收益,也不是基金管理人的保底收益承诺,而是基金管理人力争保证的价值水平。基金份额净值在大概率上会在价值线之上,但也不能完全排除小概率事件发生的风险,即基金份额净值跌破价值线的可能。

(3)价值增长线的披露

价值线数值是由基金管理人计算,并经过基金托管人核对无误后,由基金管理人公开发布。

基金托管人是独立于基金管理人的、经中国人民银行和中国证监会审查批准的商业银行。本基金的基金份额净值是由基金管理人计算,并由基金托管人核对无误后,由基金管理人公开发布;同时,根据本基金产品的特点,为保证价值线计算的准确和公允,基金管理人计算的价值线数值也是由基金托管人核对无误后,由基金管理人将其与基金份额净值一起同时对外公布。

(4)价值线计算方法

基金管理人在本基金合同中明确公布了价值增长线的计算方法,由于计算方法简便透明,投资人可自行计算,并与公布值随时核对。

需要特别说明的是,价值线固定周期(按日历计算的每180天)进行调整。本基金自基金开放日起的第一个日历日180天(第一期)内,价值线数值设为恒值0.900元;第一期结束后,即从日历日的第181天起,本基金将开始按照已公布的价值增长线计算公式定期计算。

(5)价值增长线计算的差错处理

当价值线计算差错明确为基金管理人责任时,基金管理人承诺采用最有利于基金份额持有人的结果(一般为最大值)并对外公告。

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)

法定代表人:任少华

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

注册资本:1亿元人民币

联系人:钱巍

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	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%

2. 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。

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,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。

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、公司总裁助理等职务,现任东吴基金管理有限公司督察长。

4.基金经理

戴斌先生,1982年生,博士,中国人民大学金融学专业毕业。自2007年1月起加入东吴基金管理有限公司一直从事证券投资研究工作,曾任研究部宏观经济、金融工程研究员、产品策划部产品设计研究员,基金经理助理,现任基金投资总部副总经理,其中自2013年12月24日起担任东吴新产业混合型证券投资基金基金经理,自2014年11月6日起担任东吴配置优化混合型证券投资基金基金经理,自2014年12月12日起担任东吴价值成长双动力混合型证券投资基金基金经理,自2015年5月27日起担任东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理,自2015年7月1日起担任东吴新趋势价值线灵活配置混合型基金基金经理。

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。

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

法定代表人:刘士余

成立日期:2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复[2009]13号

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]23号

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:010-66060069

传真:010-68121816

联系人:林葛

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。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司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。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。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中国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140余名,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

截止到2015年12月31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321只。

(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

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。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,独立行使监督稽核职权。

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:

(1)东吴基金管理有限公司直销中心

地址:上海市源深路279号

邮政编码:200135

电话:021-50509880

传真:021- 50509884

联系人:钱巍

客服电话:400-821-0588(免长途话费)、021-50509666

公司网址:www.scfund.com.cn

(2) 网上交易

个人投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。

网上交易网址: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:刘峰

电话:(010)85108226

传真:(010)85109219

客服电话:95599

公司网址:www.abchina.com

(2)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

(3)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:张宏革

电话:021-58781234

传真:021-58408483

客服电话:95559

公司网址:www.bankcomm.com

(4)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

(5)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

(6)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

(7)江苏银行股份有限公司

注册地址: 南京市洪武北路55号

办公地址:南京市洪武北路55号

法定代表人: 夏平

联系人:张洪玮

电话:025-58587036

传真:025-58587038

客服热线:96098,4008696098

公司网址:www.jsbchina.cn

(8)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

(9)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/

(10)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

(11)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

(12)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

(13)深圳众禄金融控股股份有限公司

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

(14)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

(15)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:021-33332830

客服热线:4008202819

公司网址:http://www.chinapnr.com/

(16)上海长量基金销售投资有限公司

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:021-68787698

客服电话:400-089-1289

公司网站: www.erichfund.com

(17)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

(18)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

(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

(20)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

(21)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

(22)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

(23)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: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

(30)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

(31)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

(32)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

(33)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

(34)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

(35)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

(36)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?

(37)申万宏源(西部)证券有限公司

英文名称:Shenwan Hongyuan Securities (Western) Co., Ltd.

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:许建平

电话:010-88085858

传真:010-88085195客户服务电话:400-800-0562

网址:www.hysec.com

联系人:李巍

(38)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

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)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

(40)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

(41)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

(42)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

(43)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

法定代表人:俞洋

电话:021-64339000

注册资本:16亿元人民币

办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号

邮政编码:200030

联系人:杨莉娟

业务联系电话:021-54967202

传真电话:021-54967293

华鑫证券公司网站:www.cfsc.com.cn

客户服务电话:021-32109999;029-68918888;4001099918

(44)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

(45)九州证券有限公司

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

(46)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

(47)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

(48)浙江金观诚财富管理有限公司

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)1幢10楼1001室

法定代表人: 徐黎云

联系人: 来舒岚

电话:0571-88337888

传真:0571-88337666

客服热线:400-068-0058

公司网址:www.jincheng-fund.com

(49)上海陆金所资产管理有限公司

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:郭坚

联系人:宁博宇

电话:021-20665952

传真:021-22066653

联系人邮箱:NINGBOYU657@pingan.com.cn

客户服务电话: 4008219031

网址:www.lufunds.com

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。

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:400-821-0588(免长途话费)、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上海分所

住所:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1901室

办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1901室

负责人:王正泮

电话:021-68866598

传真:021-68866595

经办律师:余红征、陈国东

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: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:东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:混合型基金

六、基金的投资目标

本基金为混合型基金,主要投资于代表未来发展趋势的新能源、新技术、新生活产业中的优质上市公司,在控制风险、确保基金资产流动性的前提下,力争实现净值增长持续地超越业绩比较基准。

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(含中小板,创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 0%-95%,投资于新趋势主题的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%;国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、中小企业私募债、短期融资券、公司债、中期票据、次级债、可转换债券(含分离型可转换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款以及货币市场工具等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的5%;权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。

在基金实际管理过程中,本基金具体资产配置比例由基金管理人根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化做主动调整,以求基金资产在各类资产的投资中达到风险和收益的最佳平衡,但比例不超出上述限定范围。在法律法规有新规定的情况下,基金管理人在履行适当程序后,可对上述比例做适度调整。

八、价值线描述

基金管理人根据稳健原则,依据基金过往净值增长水平,创造出一条随时间推移呈现非负增长态势的价值增长轨迹(简称价值线),用于作为基金管理人是否收取基金管理费的参考准绳,从而促使基金管理人最大限度地发挥专业研究与管理能力,力争使基金单位资产净值高于价值线水平,以实现稳健增长。有关价值线的详细内容请参见基金合同及招募说明书。

九、基金的投资策略

本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势,采取兼顾风险预算管理的多层次复合投资策略,科学严谨规范资产配置谋求基金资产的长期稳定增长。

1、大类资产配置策略

根据本基金的投资理念和风险管理方针,基金将通过战略资产配置和战术资产配置决策来确定投资组合中股票、债券和现金的比例。

从风险管理角度看,本基金资产配置策略分为两个层次:一层为对风险资产和安全资产的仓位配置,即风险资产部分所能承受的损失最大不能超过安全资产部分所产生的收益;另一层为对风险资产部分的配置策略,依据稳健投资、风险第一的原则构建风险资产组合。

从投资理念来看,本基金将基于以宏观经济分析为重点的资产类别收益风险预测框架来调整资产配置,根据宏观经济和市场情绪调整仓位,这样做到进可攻退可守。当宏观经济不佳时,我们将提高债券等安全类资产的投资比例,而股票等风险资产的风险仓位比例最低可以降到0;当宏观经济指标转好时,我们将提高股票等风险资产比例,且最高仓位比例可到95%。同时,本基金必要时,还将采用股票指数期货等衍生产品进行组合保险。

2、股票投资策略

(1)新趋势股票池的初步构建根据进一步研究界定,我们按照行业分类,将代表新趋势的上市公司分布在下述几个细分领域:

A:新能源:又称非常规能源,是指传统能源之外的各种能源形式,主要涉及的行业有汽车、有色金属、电气设备、建筑材料等行业。

B:新技术:因处于技术突破和技术创新阶段的高技术产业股票,目前主要包含的有机械设备、国防军工、公用事业、石化等行业的股票。

C:新生活:所谓"新生活"主题就是指在人们生活水平提高和生活方式变迁中所蕴藏的投资机会,如医药生物、食品饮料、农业、金融、交运、房地产、电子、计算机、传媒、通信、休闲服务、商业贸易等等行业。当未来由于经济增长方式的转变、产业结构的升级,从事或受益于上述投资主题的外延也将逐渐扩大,本基金将视实际情况调整上述新趋势主题的识别及认定。

(2)股票投资策略是本基金的核心部分,本基金秉承价值型的投资理念,在个股精选的过程中将以寻找价值被低估的股票为基本原则,在分享股价合理回归的收益的同时力求达到投资组合较高的安全边际。同时,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队的选股能力,选择具有长期持续增长能力的公司。此外,本基金还将对个股设置止损额度,以控制个股下跌的风险。

1)评价市场流动性对估值影响

股票的估值水平是一个动态的指标,受市场的流动性的影响较大,两者呈现出较强的正相关关系。同时,流动性对于上市公司的内在价值判断也具有较大的影响,主要表现在对于折现率的影响。当市场流动性较为高时,未来现金流的折现率较低,导致内在价值的升高,从而影响企业的PE水平。相反,当流动性较弱时,折现率的提高会导致内在价值的降低。因此,基金管理人在考察个股的估值水平时,将首先考虑将首先考虑当时的市场流动性的充裕程度。

2)考察行业整体估值水平的影响

个股的估值水平与行业的整体估值水平具有很大的关联性。由于受到行业基本面差异的影响,即使在市场的同一时期不同行业也会表现出估值水平上的较大差异。所以在考察目标个股的合理估值水平时,基金管理人将首先以所处行业的当时的估值均值作为主要的参考指标,并在此基础上再根据目标个股的基本面差异进行一定程度的调整。一般而言,在估值水平较低的行业中更容易挑选出具有投资价值的个股。因此,基金管理人在选择个股的过程中,将重点关注市场估值较为安全且基本面良好的行业,基金管理人主要通过与历史均值的比较和与现有市场均值的比较综合判断行业的估值水平是否处于安全区间。

3)综合考察个股的投资价值

在综合考虑市场流动性和行业