

东吴配置优化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

东吴配置优化混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)为根据《东吴保本混合型证券投资基金合同》的约定,由东吴保本混合型证券投资基金管理人第一个保本周期到期转换型而来。

东吴保本混合型证券投资基金于2012年4月12日由中证证券监督管理委员会《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[2012]506号)的核准,进行募集。东吴保本混合型证券投资基金合同于2012年8月13日正式生效。其转型后的东吴配置优化混合型证券投资基金已经中国证监会备案,《东吴配置优化混合型证券投资基金合同》于2015年6月19日生效。

基金管理人保证《东吴配置优化混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“《招募说明书》”或“《东吴招募说明书》”)的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会备案,但中国证监会对本基金募集的备案,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征,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,由于基金投资对象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、投资组合机制的风险等。

本基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金,而低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。

投资有风险,投资者在申购本基金前应认真阅读本招募说明书。基金经理过往业绩不预示未来表现。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。

本摘要根据基金合同和招募说明书编写。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即视为其对基金合同的承认和接受,并按《基金法》、《运作办法》、《托管办法》和《基金合同》及其他有关规定享有权利、承担责任。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。

本招募说明书更新之日前所载内容截止日为2016年4月19日,有关财务数据及净值表现截止日为2015年12月31日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

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:王炯
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]1132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
东吴基金管理有限公司	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、总经理办公室下设两个二级部门,分别为综合管理部与行政事务部)、人力资源部、基金事务部、信息技术部、北京办事处、财务管理部和监察稽核部、风险管理部等18个职能部门。

2.主要人员情况

范力先生,董事长,硕士,高级经济师,中共党员。历任苏州团市委常委、办公室主任兼事业部部长,苏州证券公司投资部副经理、办公室主任、人事部总经理;东吴证券有限公司总裁助理、董事会秘书、纪经理、公司副总裁、常务副总裁;东吴证券股份有限公司党委副书记、监事长、总裁。

王炯先生,总经理,硕士研究生、经济师,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。

徐静娟,员工监事,本科,学士学位,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监察稽核部总经理。

杨庆安,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公司高级项目经理、太平资产管理有限公司高级投资项目负责人,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,现担任公司基金投资总部总经理,其中自2013年6月28日起担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日起担任东吴中证转债债券指数分级证券投资基金基金经理,自2014年5月28日起担任东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理,自2014年8月19日起担任东吴配置优化混合型证券投资基金基金经理。

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、产品设计规划产品设计研究员、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日起担任东吴新兴产业基金基金经理,自2015年8月19日起担任东吴配置优化混合型证券投资基金基金经理,自2015年12月12日起担任东吴配置优化混合型证券投资基金基金经理,自2015年6月27日起担任东吴易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日起担任东吴进取价值型灵活配置混合型基金基金经理。

胡立平先生,硕士,基金经理,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,东吴基金管理有限公司常务副总裁。现任东吴基金管理有限公司总经理。

陈建峰先生,副董事长,大学学历,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、上海东兰生有限公司常务副总经理、总经理,上海东兰生(集团)有限公司营运管理部总经理。现任上海东兰生国际服务贸易(集团)有限公司投资发展部总经理。

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,东吴基金管理有限公司常务副总经。现任东吴基金管理有限公司总经理。

冯晓女士,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

东吴基金管理有限公司关于东吴鼎利分级债券型证券投资基金分级期届满与基金份额到期转换的第二次提示性公告

《东吴鼎利分级债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2016年4月25日生效,东吴鼎利分级债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)在基金合同生效后3年的分级运作期内,本基金的基金份额类别分为东吴鼎利A份额和东吴鼎利B份额。

根据基金合同的相关规定,基金合同生效后3年内每届期满,本基金无需召开基金份额持有人大会,自动转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为“东吴鼎利分级债券型证券投资基金(LOF)”。(以下简称“东吴鼎利(LOF)”)。(以下简称“东吴鼎利(LOF)”)。

根据基金合同和《东吴鼎利分级债券型证券投资基金招募说明书》的相关规定,本基金分级运作期满日为2016年4月25日。

本基金基金管理人已于2016年3月7日在《中国证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站(www.szse.cn)和东吴基金管理有限公司网站(www.scfund.com.cn)上发布了《东吴基金管理有限公司关于东吴鼎利分级债券型证券投资基金分级期届满与基金份额到期转换的第一次提示性公告》,现发布本基金分级运作期届满与基金份额转换的第一次提示性公告。

4.份额折算的公告

本基金将在份额折算时,将基金份额折算为上市开放式基金(LOF),基金管理人将按照相关法律法规的规定就本基金进行基金份额折算的相关事宜进行公告,并报中国证监会备案;

(2)在基金份额运作周期届满日前30个工作日内,基金管理人将就本基金进行基金份额转换,基金管理人将就本基金进行基金份额转换公告,并报中国证监会备案。

(3)基金份额转换后,东吴鼎利(LOF)开始办理申购与赎回、上市交易的具体日期见基金管理人届时发布的相关公告。

5.份额转换的公告

本基金将在份额折算时,将基金份额折算为上市开放式基金(LOF),基金管理人将按照相关法律法规的规定就本基金进行基金份额折算的相关事宜进行公告,并报中国证监会备案;

(2)在基金份额运作周期届满日前30个工作日内,基金管理人将就本基金进行基金份额转换,基金管理人将就本基金进行基金份额转换公告,并报中国证监会备案。

(3)基金份额转换后,东吴鼎利(LOF)开始办理申购与赎回、上市交易的具体日期见基金管理人届时发布的相关公告。

6.重要提示

1.基金份额到期转换完成后,本基金将更名为“东吴鼎利债券型证券投资基金(LOF)”。

2.本基金封闭期到期后,东吴鼎利B份额将终止在深圳证券交易所上市交易,详见基金管理人届时发布的相关公告。

3.为保证本基金份额平稳运作,自本基金的基金份额转换基准之日起,基金管理人根据中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则停止办理东吴鼎利A份额、东吴鼎利B份额的系统内转托管和跨系统转托管业务,期间详见基金管理人发布的相关公告。

4.东吴鼎利A份额表现出低风险、收益稳定的明显特征。但在本次到期转换完成后,原东吴鼎利A份额持有人将面临风险收益特征变化的风险,由持有低风险收益特征的东吴鼎利A份额转换为持有中低风险收益特征的“东吴鼎利债券型证券投资基金(LOF)”份额,该份额净值将随市场涨跌而变化,因此,原东吴鼎利A份额持有人的预期收益实现的不确定性将会增加,并还可能因此导致在市场下跌而遭受损失的风险。

5.在东吴鼎利债券型证券投资基金(LOF)份额开放上市交易或申购、赎回之前,投资人无法办理基金的赎回,存在一定的流动性风险。基金份额转换基准日东吴鼎利A份额在不具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位,或者跨系统转托管至场外销售机构,方可办理基金份额的赎回业务。

6.东吴鼎利A份额和东吴鼎利B份额基金份额转换日为基金合同生效之日起三年后的一个工作日”的规定,2016年4月22日为东吴鼎利A份额的最后开放赎回申请日。东吴鼎利A份额持有人可作出选择赎回东吴鼎利A份额或选择不赎回东吴鼎利A份额,投资者一旦选择赎回后将被默认为转入“东吴鼎利债券型证券投资基金(LOF)”份额。

7.东吴鼎利A份额和东吴鼎利B份额基金份额转换规则

东吴鼎利A份额和东吴鼎利B份额基金份额转换日为基金合同生效之日起三年后的一个工作日。

8.东吴鼎利A份额和东吴鼎利B份额基金份额转换基准日为2016年4月25日。

9.东吴鼎利A份额和东吴鼎利B份额基金份额转换方式及份额计算

本基金基金份额转换基准日当日,基金管理人将东吴鼎利A份额、东吴鼎利B份额按照各自的基金份额净值折算成净值为1.000元的上市开放式基

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2000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、立足国际、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,努力打造“以人为本”的服务品牌,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营的流程、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年首次“金牌理财”TOP100颁奖盛典“中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。

2010年再次荣获“首席财富官”杂志颁发的“最佳托管银行”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银行业监督管理委员会批准,2004年9月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障部、营运中心、委托托管部、保险资产托管部、证券投资基金托管部、境外资产托管部、综合管理处、风险管理处、内部控制处、风险管理部等部门。

3.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、律师等专业10余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好,服务质量高、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

截至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.内部控制原则

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与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、完善的内部控制体系,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,制衡机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专人负责录入,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完全独立。

(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以及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。对投资比例超上限、清算资金支付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。

3.相关服务机构

1.基金份额销售机构

1.直销机构:

东吴基金管理有限公司直销中心

注册地: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:钱巍

直销电话:(021)50509880

传真:(021)50509884

客户服务电话:400-821-0588(免长途话费)

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: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

客户服务电话:95596

公司网址:www.abchina.com

(2)中国工商银行股份有限公司

注册地:北京市西城区复兴门内大街55号(100005)

办公地址:北京市西