

东吴中证新兴产业指数证券投资基金

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 2010 年 12 月 9 日中国证券监督管理委员会《关于同意东吴中证新兴产业指数证券投资基金募集的批复》(证监基金字【2010】【1792】号)的核准,进行募集,本基金的基金合同于 2011 年 2 月 1 日正式生效。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,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。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。

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。

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》。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2018 年 8 月 1 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2018 年 6 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	出资额(万元)	占总股本比例
东吴证券股份有限公司	7000	70%
海澜集团有限公司	3000	30%
合计	10,000	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

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；东吴证券有限责任公司总裁助理、董事会秘书、经纪分公司总经理、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、常务副总裁、副董事长。现任东吴证券股份有限公司党委书记、董事长、总裁。

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，现任东吴证券股份有限公司副总裁、总规划师。

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副总经理、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，兼任深圳市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、高管人员

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；东吴证券有限责

任公司总裁助理、董事会秘书、经纪分公司总经理、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、常务副总裁、副董事长。现任东吴证券股份有限公司党委书记、董事长、总裁。

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理。现任东吴基金管理有限公司总经理。

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

周健，硕士，南开大学毕业，11年证券从业经历。曾就职于海通证券；2011年5月加入东吴基金管理有限公司，曾任公司研究策划部研究员，现任基金经理，自2012年05月03日起担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理、自2013年6月5日起担任东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理、自2016年6月3日起担任东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2016年8月11日起担任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经理，其中，自2012年10月27日至2015年5月29日担任东吴新创业混合型证券投资基金基金经理，2016年2月3日至2017年4月19日担任东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年2月5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。

朱冰兵，南京大学计算机应用专业，学士学位。曾任江苏省昆山市信托投资公司证券营业部、东吴证券营业部信息技术部系统工程师，自2003年10月参与我司筹建以来，一直就职于我司，其中2003年10月至2010年6月任系统工程师，2010年7月至今，一直从事研究工作，历任助理研究员、研究员、基金经理助理，现任基金经理，其中，自2017年3月9日起担任东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)、东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理。

周鑫烽，学士，2008年09月至2012年7月，就职于交通银行，从事数据分析工作。2012年08月加入东吴基金，从事股票投资研究交易与数据分析工作，自2018年6月4日起任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理。

历任基金经理

2011.02.01-2012.12.01 王少成

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：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：周慕冰

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：贺倩

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。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISA3402)认证,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”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号;2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号;2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号;2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”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人民银行批准成立,2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部,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近 240 名,其中具有高级职称的专家 30 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 2018 年 06 月 30 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 425 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:

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:4008210588

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：吴建

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：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

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.nccb.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：95219

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 5 层

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：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

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：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼一层

办公地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼一层

法定代表人：徐福星

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) 北京微动利投资管理有限公司

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) 奕丰金融服务(深圳)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：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：林俊波

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：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路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：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 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.cscoc.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：4008210588(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：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责任公司

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、基金的名称

本基金名称：东吴中证新兴产业指数证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：股票型指数基金

六、基金的投资目标

本基金采用指数化投资，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%，以实现对标的指数的有效跟踪。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中，中证新兴产业指数成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%，现金及到期日在一年以内的政

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。

因基金规模或市场变化等因素导致本基金投资组合不符合上述规定的，基金管理人将在 10 个工作日内调整至符合上述规定。法律、法规另有规定的，从其规定。

八、基金的投资策略

1、股票投资组合的构建

本基金对中证新兴产业指数进行完全复制，在初始建仓期或者为申购资金建仓时，本基金按照中证新兴产业指数各成份股所占权重逐步买入。在买入过程中，本基金采取相应的交易策略降低建仓成本，力求跟踪误差最小化。在投资运作过程中，本基金以标的指数权重为标准配置个股，并进行适时调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

2、股票投资组合的调整

（1）组合调整原则

本基金为完全复制的指数型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、配股增发因素等变化，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。

（2）组合调整方法

1) 定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据中证新兴产业指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。本基金将按照标的指数对成份股及其权重的调整方案，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行相应调整。

2) 不定期调整

在一些特殊情况下，我们将适当调整投资标的。

根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据标的指数权重比例的变化，进行相应调整。

当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置，基金管理人将综合考虑跟踪误差和投资者利益，选择相关股票进行适当的替代。

根据本基金的申购赎回情况，对组合进行相应调整，力求达到跟踪误差最小化。

3) 在其他不影响指数复制的情况下, 本基金管理人可以根据市场情况, 在跟踪误差最小化的条件下, 对基金资产组合进行适当的调整。

3、替代成份股的构建

本基金选择其他中证新兴产业指数成份股或备选成份股构建替代成份股。

4、基金组合的优化策略

本基金对由于仓位限制、基金费用、成份股调整、申购赎回等因素会产生的跟踪误差, 采取适当策略进行修正。

(1) 成份股权重策略

针对建仓期间仓位未达到目标水平、应付赎回、配股增发的现金预留引起仓位不足、申购资金与分红资金等资金流入导致仓位不足、换股期间成分股操作引起仓位变动等导致基金仓位低于基准而产生的跟踪误差, 该策略根据降低跟踪误差的原则, 通过衡量相应成份股的基本面和流动性, 在指数成份股标准权重的基础上进行微调。

(2) 交易策略

针对由于基金管理费、托管费、交易费用、冲击成本等因素产生的跟踪误差, 该策略主要通过通过在基金建仓和成份股调整时, 低买高卖或提前建仓以减小冲击成本等进行修正。

5、跟踪误差控制

本基金主要通过“跟踪误差”和“跟踪偏离度”两个指标, 对跟踪误差进行控制管理, 确保基金对指数的紧密跟踪。

本基金定期计算基金组合的跟踪误差和跟踪偏离度, 确保单日基金跟踪偏离度不高于0.35%, 年度跟踪误差不超过4%。特殊情况下, 本基金通过定性研究和定量分析方法, 对基金资产组合进行适当调整, 以期在约定的风险承受限度之内, 尽量缩小跟踪误差。

6、债券投资策略

本基金采取积极的债券投资管理策略。采用自上而下的方式制定具体投资策略, 考虑的主要因素是: 宏观经济走势、资金供求状况、基础利率、债券收益率曲线、市场波动等。基金管理人将根据利率变化的大周期、市场运行的小周期和中国债券市场的固定特性, 结合基金申购赎回的情况, 判断基金对流动性的需求, 制定相应的债券投资策略。

本基金债券投资主要是流动性管理的需要、获取适当收益, 因此债券投资以流动性好, 风险较小的短期政府债券为主; 中国的债券市场处于扩张阶段, 品种不断丰富、衍生工具有所增加, 本基金的债券投资将注重新品种的选择和创新工具的运用, 以流动性好、风险低的品种作为投资目标。

九、业绩比较基准

基金业绩比较基准=95%*中证新兴产业指数收益率+5%*银行同业存款利率

中证新兴产业指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数精选在上海证券交易所和深圳证券交易所中上市的规模大、流动性好的 100 家新兴产业公司作为样本，综合反映了沪深证券市场中新兴产业公司的整体表现。

本基金认为，该业绩比较基准目前能够有效地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在履行适当程序后变更业绩比较基准。经与基金托管人协商一致，并在中国证监会指定的媒体以及公司网站上公告。

十、风险收益特征

本基金属于股票型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金以及混合型基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪中证新兴产业指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益也较高的品种。

十一、基金投资组合报告

东吴中证新兴产业指数证券投资基金(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农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 7 月 17 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 6 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	85,516,079.45	94.43
	其中:股票	85,516,079.45	94.43
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	4,781,366.66	5.28
8	其他资产	260,020.67	0.29
9	合计	90,557,466.78	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末指数投资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	1,491,224.00	1.66
C	制造业	60,624,310.18	67.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,399,643.00	2.67
E	建筑业	1,129,048.00	1.25
F	批发和零售业	2,278,341.00	2.53
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	10,744,412.10	11.94
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	860,151.60	0.96
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,599,526.34	1.78
O	居民服务、修理和其	-	-

	他服务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,752,592.00	1.95
R	文化、体育和娱乐业	965,064.00	1.07
S	综合	-	-
	合计	83,844,312.22	93.16

(2) 报告期末积极投资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	采掘业	-	-
C	制造业	1,457,498.95	1.62
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	214,268.28	0.24
S	综合	-	-
	合计	1,671,767.23	1.86

(3) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

(1) 报告期末指数投资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	600309	万华化学	37,591	1,707,383.22	1.90
2	300122	智飞生物	30,228	1,382,628.72	1.54
3	000963	华东医药	27,668	1,334,981.00	1.48
4	600276	恒瑞医药	17,256	1,307,314.56	1.45
5	600535	天士力	46,994	1,213,385.08	1.35
6	600196	复星医药	27,627	1,143,481.53	1.27
7	000538	云南白药	10,566	1,130,139.36	1.26
8	300059	东方财富	83,120	1,095,521.60	1.22
9	600104	上汽集团	31,296	1,095,047.04	1.22
10	600332	白云山	28,039	1,066,883.95	1.19

(2) 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明

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	600485	信威集团	67,805	989,274.95	1.10
2	000008	神州高铁	94,400	468,224.00	0.52
3	000156	华数传媒	22,227	214,268.28	0.24

4、报告期末按债券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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

11、投资组合报告附注

11.1

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。

11.2

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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,578.47
2	应收证券清算款	230,976.36
3	应收股利	-
4	应收利息	896.07
5	应收申购款	17,569.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	260,020.67

11.4 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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600485	信威集团	989,274.95	1.10	重大资产重组
2	000008	神州高铁	468,224.00	0.52	重大事项停牌

11.6 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。

(一) 东吴中证新兴产业指数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

时间	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
2011.02.01-2011.12.31	-32.70%	1.27%	-29.54%	1.40%	-3.16%	-0.13%
2012.01.01-2012.12.31	-2.82%	1.40%	-1.30%	1.41%	-1.52%	0.00%
2013.01.01-2013.12.31	22.32%	1.47%	22.88%	1.47%	-0.56%	0.00%
2014.01.01-2014.12.31	27.50%	1.14%	28.22%	1.15%	-0.72%	-0.01%
2015.01.01-2015.12.31	29.61%	2.89%	33.57%	2.72%	-3.96%	0.17%
2016.01.01-2016.12.31	-16.57%	1.68%	-17.35%	1.65%	0.78%	0.03%
2017.01.01-2017.12.31	13.60%	0.80%	10.26%	0.81%	3.34%	-0.01%
2018.01.01-2018.06.30	-13.89%	1.32%	-13.19%	1.31%	-0.70%	0.01%
2011.02.01-2018.06.30	7.90%	1.62%	14.67%	1.59%	-6.77%	0.03%

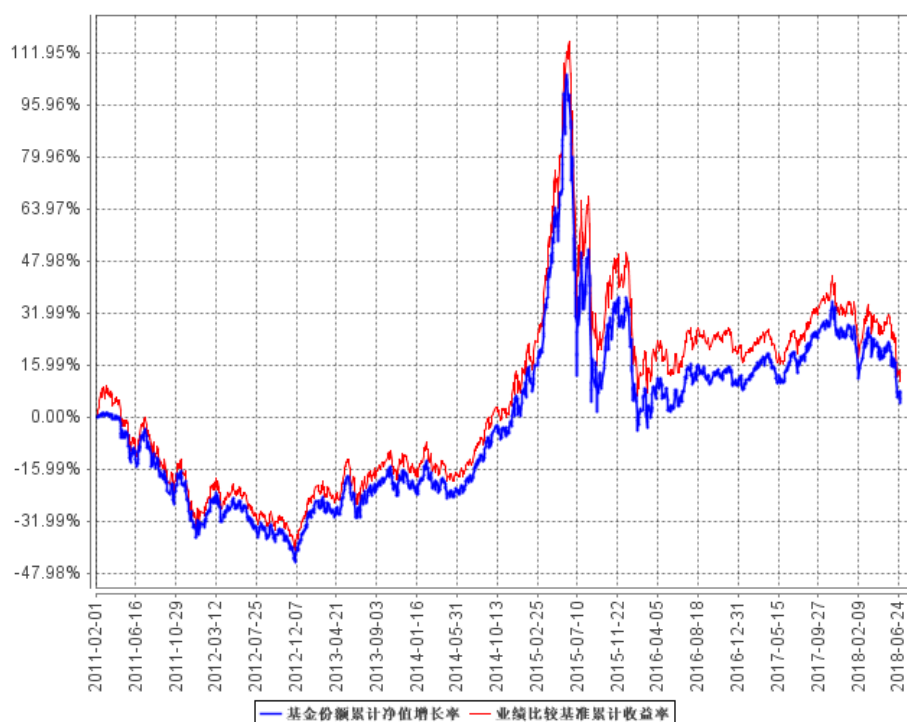
注:基金业绩比较基准=95%*中证新兴产业指数收益率+5%*银行同业存款利率,数据截止到2018年6月

30日。

(二) 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩基准收益率的比较图

(2011年02月01日至2018年6月30日)

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：业绩比较基准=95%*中证新兴产业指数收益率+5%*银行同业存款利率

十三、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

1、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。

2、开通转换的销售机构

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、北京微动利投资管理有限公司、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、奕丰金融服务(深圳)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、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。

十四、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、基金合同生效后的信息披露费用；
- 4、基金份额持有人大会费用；
- 5、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金财产拨划支付的银行费用；
- 8、基金的指数使用费；
- 9、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规和基金合同另有规定时从其规定。

(三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

- 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年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$, 本基金年管理费率为 1%

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年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}, \text{本基金年托管费率为 } 0.15\%$$

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、上述(一)中 3 到 8 项费用由基金托管人根据其他有关法律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。

(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。基金募集期间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,基金收取认购费的,可以从认购费中列支。

(五) 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。降低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

(六) 基金销售的相关费用

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”的相关规定。

具体申购费率如下:

申购金额(含申购费)	申购费率
100万元以下	1.2%
100万元以上(含)-200万元以下	0.8%
200万元以上(含)-500万元以下	0.4%
500万元以上(含)	1000元/笔

赎回费随基金持有时间的增加而递减,费率如下:

持有时间	赎回费率
7天以内(不含7天)	1.5%
7天-1年(含1年)	0.5%
1年-2年(含2年)	0.25%
2年以上	0

(七)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

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“一、绪言”中,对相关内容进行了更新。
- 3、在“二、释义”中,对相关内容进行了更新。
- 4、在“三、基金管理人”中,对相关内容进行了更新。
- 5、在“四、基金托管人”中,对相关内容进行了更新。
- 6、在“五、相关服务机构”中,对相关内容进行了更新。
- 7、在“八、基金份额的申购与赎回”中,对相关内容进行了更新。
- 8、在“九、基金的投资”中,对相关内容进行了更新。
- 9、在“十、基金的业绩”中,对相关内容进行了更新。
- 10、在“十二、基金资产估值”中,对相关内容进行了更新。
- 11、在“十六、基金的信息披露”中,对相关内容进行了更新。
- 12、在“十七、基金的风险提示”中,对相关内容进行了更新。
- 13、在“二十、基金托管协议的内容摘要”中,对相关内容进行了更新。
- 14、在“二十二、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9月14日签署。

东吴基金管理有限公司

二零一八年九月十四日