

# 东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

## 更新招募说明书摘要

东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金基金合同于 2009 年 05 月 06 日经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：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 2009 年 2 月 20 日中国证券监督管理委员会《关于核准东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金募集的批复》（证监许可【2009】140 号）的核准，进行募集。

基金管理人保证《东吴进取策略灵活配置混合型开放式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。

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。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2012年11月6日，有关财务数据和净值表现截止日为2012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》”)、《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《东吴进取策略灵活配置混合型开放式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。

## 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：徐建平
5. 成立日期：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
8. 注册资本：1亿元人民币
9. 联系人：吴靖
10. 电话：(021) 50509888
11. 传真：(021) 50509884
12. 客户服务电话：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	4900	49%
上海兰生（集团）有限公司	3000	30%
江阴澄星实业集团有限公司	2100	21%
合 计	10,000	100%

## 15. 简要情况介绍：

东吴基金管理有限公司下设投资管理部、研究策划部、国际业务部、产品策略部、市场营销部、机构理财部、基金事务部、信息技术部、总裁办、行政事务部、财务管理部、专户投资部和监察稽核部等 13 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股票型证券投资基金，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股票型证券投资基金，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股票型证券投资基金，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股票型证券投资基金，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股票型证券投资基金，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。

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

#### 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、苏州市税务局三分局局长、苏州市税务局科长、苏州市审计局副局长。现任东吴证券股份有限公司董事长，中共东吴证券股份有限公司党委书记。

金燕萍女士，副董事长，大学，高级政工师，中共党员。历任上海外贸总公司党委委员、党委办公室副主任，上海海外公司党总支部书记，上海广告公司党委副书记、副总经理，上海实业（集团）有限公司办事处常务副主任、党总支部书记。现任上海兰生（集团）有限公司总裁助理兼投资管理部总经理。

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，东吴证券有限责任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。

吴亮先生，董事，硕士，经济师，中共党员。历任农行无锡分行国际业务部综合部副经理、农行无锡锡山支行国际业务部经理、农行无锡分行国际业务部副总经理，农行江阴市支行副行长，现任江阴澄星实业集团有限公司副总裁。

王金来先生，董事，大学，经济师，中共党员。历任苏州市二轻局秘书，苏州市经济体制改革委员会副科长、处长、助理调研员，兼苏州市证券期货监督管理办公室证券处处长和苏州市企业上市工作办公室证券处处长，东吴证券有限责任公司投行总部副总经理。现任东吴证券股份有限公司董事长助理兼行政总监。

戴继雄先生，董事，硕士，历任上海复星高科技（集团）有限公司财务、审计副总监，现担任上海兰生（集团）有限公司财务副总监、财务金融部总经理。

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。

张平先生，独立董事，教授，博士生导师。历任中国社科院经济研究所研究员、所长助理，现任中国社科院经济研究所副所长。

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

沈国强先生，监事长，大专，经济师。历任人民银行盐城分行、苏州分行科员，工商银行苏州分行咨询部主任，苏州证券业务部、经济管理部、研究发展中心、投行总经理，苏州证券经纪总监兼经纪管理部、研究发展中心总经理，苏州证券总裁助理兼市场发展部总经理，苏州证券公司、苏州证券有限责任公司两届监事，东吴证券监事会主席兼总裁助理、稽核部负责人，东吴证券监事会主席、稽核部负责人。

周忠明先生，监事，硕士研究生，会计师，中共党员。曾任江苏澄星磷化工股份有限公司副总经理兼财务总监、董事长，现任江阴澄星实业集团有限公司副总裁。

黎璜女士，员工监事，硕士研究生，经济师，中共党员。曾就职于上海证券综合研究有限公司、长城证券有限责任公司，现任东吴基金管理有限公司研究总监兼研究策划部总经理。

## 3. 高管人员

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）

胡玉杰女士，副总经理，经济学硕士，历任大鹏证券有限责任公司营业部总经理、融资服务公司董事、副总经理；2004年9月加入东吴基金管理有限公司任市场总监职务；2008年7月起至今任东吴基金管理有限公司副总经理。

吴威先生，督察长，经济学博士，历任兴业证券股份有限公司研究发展中心高级研究员、国际业务部负责人，兴业基金管理有限公司筹备组成员，兴业基金管理有限公司副总经理，日本野村证券北京代表处业务拓展总监。现任东吴基金管理有限公司督察长。

## 4、基金经理

唐祝益先生，经济学硕士，南京大学毕业，曾任上海证券综合研究有限公司证券分析师、华鑫证券投资经理、海通证券投资经理等职；2009年8月加入东吴基金管理有限公司，现担任投资副总监兼投资管理部总经理、东吴进取策略混合基金经理、东吴深证100指数增强（LOF）基金经理，自2012年4月6日任本基金基金经理。

历任基金经理：

朱昆鹏先生，中国人民大学毕业，经济学学士，曾担任云南国际信托投资有限公司研

究员、资产管理部副总经理，国金证券高级投资经理，云南国际信托有限公司信托经理，2009年12月23日起至2012年4月6日任东吴进取策略灵活配置基金基金经理。

王炯女士，毕业于武汉大学，获硕士学位，曾在大鹏证券研究所和投资部担任研究员、首席分析师助理等职务，2004年加入东吴基金。2009年5月6日至2011年5月14日担任东吴进取策略基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

任少华 总经理；

黎 瑛 研究总监、研究策划部总经理；

陈 宪 首席策略规划师；

唐祝益 投资副总监兼投资管理部总经理、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金基金经理、东吴深证100指数增强型证券投资基金基金经理；

任 壮 研究副总监兼研究策划部副总经理、东吴行业轮动股票型证券投资基金基金经理、东吴新产业精选股票型证券投资基金；

丁 蕙 东吴优信稳健债券型证券投资基金基金经理、东吴保本混合型证券投资基金基金经理；

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司

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：蒋超良

成立时间：2009年1月15日

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

组织形式：股份有限公司

基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

电话：010-63201510

传真：010-63201816

联系人：李芳菲

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 146 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

截至 2012 年 11 月 6 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 133 只，包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金、南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴



货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金 (LOF)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元比联保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金 (LOF)、交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲 (除日本) 机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国 7 天理财宝债券型证券投资基金。

### 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：徐建平

联系人：吴靖

直销电话：（021）50509880

传真：（021）50509884

客户服务电话：（021）50509666

网站：[www.scfund.com.cn](http://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：项俊波

联系人：刘一宁

电话：（010）85108227

传真：（010）85109219

客服电话：95599

公司网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

### （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

法定代表人：孔丹

联系人：丰靖

电话：010-65557013

传真：010-65550827

客服电话：95558

公司网址：<http://bank.ecitic.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

联系人：张静

传真：（010）66275654

客服电话：95533

公司网址：www.ccb.com

(4) 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：刘业伟

传真：(010) 66107914

客服电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

(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：胡怀邦

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) 深圳发展银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁(Frank Neil Newman)

联系人：张青

电话：0755-82088888

传真：0755-82080406

客服电话：95501

公司网址：www.sdb.com.cn

(9) 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：董云巍

电话：(010)57092615

传真：(010)57092611

客服电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

(10) 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.nbc.com.cn

(11) 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](http://www.psbc.com)

(12) 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：蔡宇洲

电话：0755-22197874

传真：0755-22197701

客服电话：40066-99999（免长途费）0755-961202

公司网址：[www.pingan.com](http://www.pingan.com)

(13) 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](http://www.wzbank.cn)

(14) 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：庄永辉

联系人：姚华

电话：0535-6691337

传真：0535-6680900

客服电话：4008-311-777

公司网址：[www.yantaibank.net](http://www.yantaibank.net)

(15) 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

法定代表人：吴永敏

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](http://www.dwzq.com.cn)

（16）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](http://www.htsec.com)

（17）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：顾伟国

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](http://www.chinastock.com.cn)

（18）申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海常熟路 171 号

办公地址：上海常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

联系人：邓寒冰

电话：021-54033888

传真：021-54038844

客服电话：021-962505

公司网址：[www.sywg.com.cn](http://www.sywg.com.cn)

（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) 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、41 和 42 楼

法定代表人：林治海

联系人：黄岚

电话：020-87555888

传真：020-87555305

客服电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

(21) 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

(22) 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

## (23) 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](http://www.xcsc.com)

## (24) 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](http://www.cgws.com)

## (25) 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](http://www.glsc.com.cn)

## (26) 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) 38676666

传真：(021) 38670666



客服电话：400-8888-666

公司网址：www.gtja.com.

(27) 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：王佳佳

电话：0755-83199599

传真：0755-83199545

客服电话：0755-83199511

公司网址：www.csco.com.cn

(28) 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

(29) 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：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客服电话：021-962506

公司网址：www.dfzq.com.cn

(30) 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](http://www.essence.com.cn)

(31) 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：025-84457777-721

传真：025-84579763

联系人：程高峰

客服电话：95597

公司网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(32) 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](http://www.avicsec.com)

(33) 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](http://www.cfzq.com)

(34) 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 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

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：张智河

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客服电话：0532-96577

公司网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

（35）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：徐浩明

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨、李芳芳

客服电话：400888788、10108998

公司网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

（36）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：王春峰

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](http://www.bhzq.com)

（37）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

电话：(021) 50372474

传真：(021) 50372474

客户服务电话：4006208888

公司网址：[www.bocichina.com](http://www.bocichina.com)

（38）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

(39) 齐鲁证券有限公司

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

(40) 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

(41) 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

## (42) 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](http://www.njzq.com.cn)

## (43) 东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼

法定代表人：朱科敏

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

联系人：梁旭

联系电话：0519-88157761

联系传真：0519-88157761

免费服务热线：400-888-8588

公司网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

## (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](http://www.china-invs.cn)

## (45) 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：郭林

联系人：陈敏

电话：021-32229888-3121

传真：021-62878783

客服电话：021-63340678

公司网址：www.ajzq.com

（46）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：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层

法定代表人：林义相

联系人：林爽

电话：010-66045608

传真：010-66045500

客服服务热线：010-66045678

天相投顾网-网址：www.txsec.com

天相基金网-网址：www.txjjin.com

（47）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：陈康菲

电话：021-50122222

传真：021-50122200

客服电话：4008209898

公司网址：www.cnhbstock.com

（48）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼（518048）

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：0755-82400862

传真：0755-82433794

客服热线：4008816168

公司网址：www.PINGAN.com

（49）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：胡运钊

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](http://www.95579.com)

（50）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](http://www.hfzq.com.cn)

（51）宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

电话：010-88085858

传真：010-88085219

客服电话：400-800-0562

公司网址：[www.hysec.com](http://www.hysec.com)

（52）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心

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](http://www.cindasc.com)

(53) 华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座

法定代表人：李工

联系人：甘霖

电话：0551-5161666

传真：0551-5161600

客服电话：0551-96518 或者 4008096518

公司网址：[www.hazq.com](http://www.hazq.com)

(54) 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：021-33303353

客服电话：4008918918

公司网址：[www.shzq.com](http://www.shzq.com)

(55) 广州证券有限责任公司

注册地址：广州市越秀区先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

办公地址：广州市越秀区先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

法定代表人：吴志明

联系人：林洁茹

电话：020-87322668

传真：020-87325036

客服电话：020-961303

公司网址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

(56) 厦门证券有限公司

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：傅毅辉

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](http://www.xmzq.com.cn)

(57) 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](http://www.cs.ecitic.com)

(58) 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：高竹

联系人：高克南

电话：0755-82545707

传真：0755-82545500

客服热线：40018-40028

公司网址：[www.wkzq.com.cn](http://www.wkzq.com.cn)

(59) 天源证券经纪有限公司

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

电话：0755-33331188

传真：0755-33329815

客服热线：4006543218

公司网址：[www.tyzq.com.cn](http://www.tyzq.com.cn)

(60) 财富里昂证券有限责任公司

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

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](http://www.cf-clsa.com)

(61) 中信证券（浙江）有限责任公司

住所：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

法定代表人：沈强

电话：0571-87112510

传真：0571-86065161

联系人：丁思聪

网址：[www.bigsun.com.cn](http://www.bigsun.com.cn)

客户服务电话：0571-96598

(62) 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](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(63) 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](http://www.cfsc.com.cn)

(64) 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

（65）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：浙江省杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室

法定代表人：李晓涛

联系人：杨翼

电话：0571-88911818 转 8565

传真：0571—86800423

客服热线：0571-88920897

公司网址：http://www.ijijin.com.cn

## （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：徐建平

联系人：吴靖

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：北京东城区东四十条68号平安发展大厦3层

办公地址：北京东城区东四十条68号平安发展大厦3层

负责人：陶修明

电话：010-84085338

传真：010-84085858

经办律师：陈冲冲、余红征

## （四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：江苏公证天业会计师事务所有限公司  
注册地址：无锡市新区开发区旺庄路生活区  
办公地址：中国苏州新市路130号宏基大厦五楼  
法定代表人：张彩斌  
经办注册会计师：叶水林 吕卫星  
电话：0512-65260880  
传真：0512-65186030

#### 四、基金的名称

本基金名称：东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

#### 五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式混合型基金

#### 六、基金的投资目标

本基金为混合型基金，在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，以成长股作为投资对象，并对不同成长类型股票采取不同操作策略，追求超额收益。

#### 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、债券、权证、以及法律法规或经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金为灵活配置混合型基金，投资组合中股票类资产投资比例为基金资产的30%-80%，固定收益类资产投资比例为基金资产的0-70%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金投资于权证、以及其它金融工具投资比例遵从法律法规及监管机构的规定。

对于中国证监会允许投资的其他金融产品，将依据有关法律法规进行投资管理。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### 八、基金的投资策略

本基金采取自上而下策略，根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，对基金资产在股票、债券、现金和衍生产品上的投资比例进行灵活配置。在股票投资策略上，本基金根据上市公司成长特征，将上市公司分成三种类型：长期快速成长型公司；周期成长型公司；转型成长型公司。对于不同成长类型的股票，本基金将采取买入持有操作策略（兼顾波段操作策略）、或者周期持有策略进行投资组合管理，提高投资收益。

本基金的投资策略主要体现在资产配置策略、选股策略、股票操作策略、债券投资策略、

权证投资策略等几方面。

### 1、资产配置策略

对于大类资产的配置，本基金主要是由投资研究团队根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势和风险收益水平。在各大类资产投资比例限制前提下，根据大类资产风险收益分析结果，并结合本基金风险收益目标，灵活确定基金资产在股票、债券、现金和衍生产品上的配置比例。

### 2、选股策略

本基金以成长为导向，选取未来快速成长的股票作为投资对象。企业业绩成长可以分为两类：内涵式增长和外延式增长。内涵式增长是指企业依靠自身技术、管理等能力而获得业绩的增长。根据企业成长对宏观经济的敏感性不同，内涵式增长又可分为稳定型增长和周期型增长。稳定型增长是指企业业绩增长与经济周期敏感性相对较低；周期型增长是指企业业绩增长与经济周期敏感性相对较高。外延式增长是指企业通过收购、兼并、或者重组等方式带来业绩增长，这类增长方式能带来企业业绩短期爆发增长。

根据上市公司成长特征，可将成长型上市公司分成三种类型：长期快速成长型公司；周期成长型公司；转型成长型公司。对于不同成长型公司，本基金将根据相应价值投资评价体系精选投资价值高的股票，进入本基金的股票池。

### 3、股票操作策略

对于不同成长特征的股票，在经济周期不同阶段内，其股价表现是不同的。本基金根据以上三种类型股票股价与经济周期之间的关系，确定股票资产的配置。具体策略是：

(1)在经济周期上升阶段，加大周期成长型股票配置比例，并保持适度的稳定型行业中快速成长型股票的配置比例。

(2)在经济周期下降阶段，加大稳定型行业中快速成长型股票的配置比例；降低周期型股票配置比例。

(3)对于转型类股票的配置，由于其股价走势基本不受经济周期的约束，所以，只要能够确定转型成功，并将使公司业绩发生根本变化，就可以买入持有，但最高配置比例不超过股票资产的 30%。

为了规避股票资产配置过度集中于某一类型股票而带来投资风险，本基金对不同成长类型股票投资比例进行了一定限制：

(1)对于长期快速成长型股票，配置比例不低于股票资产的 30%；

(2)对于周期成长型股票，最高配置比例不超过股票资产的 60%；

(3)对于转型成长型股票，最高配置比例不超过股票资产的30%。

从实际投资经验看，股票操作策略主要有两种：一种是买入持有操作策略；另一种是周期持有策略。本基金对具有不同成长特征的股票将采取不同操作策略进行投资组合管理，具体原则是：

(1)对于快速成长型股票，采取中长期买入持有操作策略，但不片面强调中长期静态持有。具体而言：本基金根据对上市公司成长性动态变化的分析预测，兼顾考虑当时的市场趋势，通过对股票价格与价值相对偏离程度的分析，对快速成长型股票适时进行一定比例仓位的波段操作。

(2)对于周期成长型股票，采取周期持有策略。在行业景气复苏和上升阶段，逐步增加周期型股票配置比例；在行业景气达到顶峰之前逐步降低周期型股票配置比例。

(3)对转型成长型股票，采取中短期买入持有操作策略。

#### 4、债券投资策略

本基金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扩张特征，制定相应的债券投资策略，以获取利息收益为主、资本利得为辅。

#### 5、权证投资策略

本基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

### 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准：

本基金整体业绩比较基准=65%\*沪深300指数+35%\*中信标普全债指数。

### 十、基金的风险收益特征

本基金是一只进行主动投资的混合型基金，其风险和预期收益要低于股票型基金，高于货币市场基金和债券型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益也较高的基金产品。

### 十一、基金的投资组合报告

东吴进取策略灵活配置混合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农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月19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。

## 1、截至 2012 年 9 月 30 日基金资产组合情况：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	622,061,101.06	76.04
	其中：股票	622,061,101.06	76.04
2	固定收益投资	78,328,949.80	9.57
	其中：债券	78,328,949.80	9.57
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	108,707,874.97	13.29
6	其他各项资产	8,997,961.75	1.10
7	合计	818,095,887.58	100.00

## 2、截至 2012 年 9 月 30 日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	32,165,623.45	4.01
B	采掘业	-	-
C	制造业	400,838,974.36	49.91
C0	食品、饮料	126,744,145.28	15.78
C1	纺织、服装、皮毛	13,711,393.62	1.71
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	54,376,762.01	6.77
C5	电子	30,386,851.00	3.78
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	94,266,498.07	11.74
C8	医药、生物制品	81,353,324.38	10.13
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,094,180.00	0.63
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	44,827,092.13	5.58
H	批发和零售贸易	19,246,824.26	2.40
I	金融、保险业	68,499,350.16	8.53
J	房地产业	15,912,477.70	1.98
K	社会服务业	35,476,579.00	4.42
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	622,061,101.06	77.46

## 3、截至 2012 年 9 月 30 日，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	000858	五粮液	1,169,967	39,661,881.30	4.94
2	000423	东阿阿胶	889,996	34,460,645.12	4.29

3	600104	上汽集团	2,399,905	32,494,713.70	4.05
4	002477	雏鹰农牧	1,782,029	32,165,623.45	4.01
5	600588	用友软件	2,223,305	31,326,367.45	3.90
6	002157	正邦科技	3,179,926	29,668,709.58	3.69
7	600267	海正药业	1,870,392	29,234,226.96	3.64
8	000895	双汇发展	477,000	28,858,500.00	3.59
9	600587	新华医疗	948,391	27,313,660.80	3.40
10	601628	中国人寿	1,400,000	26,460,000.00	3.29

#### 4、截至 2012 年 9 月 30 日，按券种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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	78,328,949.80	9.75
8	其他	-	-
9	合计	78,328,949.80	9.75

#### 5、截至 2012 年 9 月 30 日，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	113001	中行转债	300,000	28,848,000.00	3.59
2	110003	新钢转债	222,480	22,810,874.40	2.84
3	113002	工行转债	130,000	13,130,000.00	1.63
4	110017	中海转债	120,000	10,923,600.00	1.36
5	126729	燕京转债	25,564	2,616,475.40	0.33

#### 6、截至 2012 年 9 月 30 日，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 2012 年 9 月 30 日，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。

#### 8、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末没有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 2012 年 9 月 30 日，其他资产构成



序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	8,772,235.23
3	应收股利	-
4	应收利息	197,290.10
5	应收申购款	28,436.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,997,961.75

## 4) 截至 2012 年 9 月 30 日, 持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	28,848,000.00	3.59
2	110003	新钢转债	22,810,874.40	2.84
3	113002	工行转债	13,130,000.00	1.63
4	110017	中海转债	10,923,600.00	1.36
5	126729	燕京转债	2,616,475.40	0.33

## 5) 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。

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. 东吴进取策略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

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
2009.05.06-2009.12.31	6.94%	1.11%	20.31%	1.28%	-13.37%	-0.17%
2010.01.01-2010.12.31	21.24%	1.30%	-7.43%	1.03%	28.67%	0.27%
2011.01.01-2011.12.31	-30.45%	1.22%	-14.93%	0.85%	-15.52%	0.37%

2012.01.01-2012.09.30	-3.20%	1.07%	-0.42%	0.83%	-2.78%	0.24%
2009.05.06-2012.09.30	-12.72%	1.19%	-7.09%	1.00%	-5.63%	0.19%

注：统计截至 2012 年 9 月 30 日，比较基准=比较基准=65%\*沪深 300 指数+35%\*中信标普全债指数。

## 2. 东吴进取策略灵活配置混合基金累计净值增长率历史走势图

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 05 月 06 日至 2012 年 9 月 30 日）

东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金



## 十三、费用概览

### （一）基金运作相关费用

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. 基金财产划拨支付的银行费用；
8. 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

### （二）基金销售相关费用

1、本基金申购费由申购人承担，用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。

2、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	1.5%
100万元以上（含）-200万元以下	1.2%
200万元以上（含）-500万元以下	0.8%
500万元以上（含）	1000元/笔

3、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
1 年以内（含 1 年）	0.5%
1 年- 2 年（含 2 年）	0.25%
2 年以上	0

4、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。

#### 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》、《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，更新了相关内容。
- 2、在“三、基金管理人”中，更新了相关内容。
- 3、在“四、基金托管人”中，更新了相关内容。
- 4、在“五、相关服务机构”中，更新了相关内容。
- 5、在“八、基金份额的申购与赎回”中，更新了相关内容。
- 6、在“十、基金的投资”中，更新了相关内容。
- 7、在“十一、基金的业绩”中，更新了相关内容。
- 8、在“二十二、对份额持有人的服务”中，更新了相关内容。
- 9、在“二十三、其他应披露事项”中，更新了其他披露事项：

(1) 2012 年 06 月 05 日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于新增深圳众禄基金为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告》；

(2) 2012年06月05日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于在深圳众禄基金网上申购费率及定投申购费率优惠的公告》；

(3) 2012年06月18日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金更新招募说明书摘要（2012年6月）》；

(4) 2012年06月28日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于在交通银行网上银行、手机银行延长基金申购费率优惠的公告》；

(5) 2012年06月28日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于在中信银行网上银行、移动银行延长基金申购费率优惠的公告》；

(6) 2012年07月11日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于新增华鑫证券为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告》；

(7) 2012年07月20日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金2012年第二季度报告》；

(8) 2012年07月24日在证券时报、中国证券报、上海证券报、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财富里昂开通转换业务的公告》；

(9) 2012年08月25日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金2012年半年度报告摘要》、《东吴基金管理有限公司东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金2012年半年度报告》；

(10) 2012年09月18日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司行业高级管理人员变更公告》；

(11) 2012年10月15日在证券时报、中国证券报、上海证券报、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国海证券为代销机构并推出定期定额及转换业务的公告》；

(12) 2012年10月17日在证券时报、中国证券报、上海证券报、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同花顺网上交易定投申购费率优惠的公告》；

(13) 2012年10月17日在证券时报、中国证券报、上海证券报、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同花顺为代销机构并推出定期定额及转换业务的公告》；

(14) 2012年10月25日在证券时报、中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金2012年第三季度报告》；

(15) 2012年11月05日在证券时报、中国证券报、上海证券报、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华鑫证券自助式交易系统申购与定投开放式基金前端费率优惠活动的公告》；

东吴基金管理有限公司  
二零一二年十二月二十日