

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 2016 年 2 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)。

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：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】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%

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（下设二个二级部门，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 19 个职能部门。

（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。

陈辉峰先生，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。

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，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。

冯玉泉先生，董事，硕士研究生，经济师，中共党员。历任东吴证券苏州石路营业部总经理、东吴证券客户资产存管中心总经理、风险管理总部总经理、合规副总监兼风险合规总部总经理。现任东吴证券股份有限公司人力资源总监兼人力资源部总经理。

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。

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，总经理，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。

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

周健先生，硕士，南开大学毕业，9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，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。

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

王炯 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 6 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 287 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、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、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、大成债券证券投资基金、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、金元惠理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、金元惠理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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (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 (LOF)、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、金元惠理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、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、东吴配置优化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、交银施罗德理财 21 天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金（LOF）、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财 21 天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家 14 天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资

基金、南方稳利一年定期开放债券型证券投资基金、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、华夏永福养老理财混合型证券投资基金、嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、易方达投资级信用债债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华润元大保本混合型证券投资基金、长盛双月红一年期定期开放债券型证券投资基金、富国国有企业债券型证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、嘉实活期宝货币市场基金、融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、前海开源可转债债券型发起式证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城创业板精选股票型证券投资基金、中邮双动力混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金、中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金、前海开源沪深 300 指数型证券投资基金、天弘季加利理财债券型证券投资基金、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、招商可转债分级债券型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金、华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金、中海惠祥分级债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、银华双月定期理财债券型证券投资基金、嘉实新兴产业股票型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基

金、招商招利 1 个月期理财债券型证券投资基金、工银瑞信高端制造行业股票型证券投资基金、工银瑞信添益快线货币市场基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、中证 500 医药卫生指数交易型开放式指数证券投资基金、富国天时货币市场基金、鹏华先进制造股票型证券投资基金、大成纳斯达克 100 指数证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、南方理财金交易型货币市场基金、工银瑞信创新动力股票型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金 (LOF)、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金、前海开源股息率 100 强等权重股票型证券投资基金、国开泰富货币市场证券投资基金、大成高新技术产业股票型证券投资基金、富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金、鹏华可转债债券型证券投资基金、华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金、工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、中证 500 工业指数交易型开放式指数证券投资基金、华融新锐灵活配置混合型证券投资基金、中证 500 原材料指数交易型开放式指数证券投资基金、华安智能装备主题股票型证券投资基金、宝盈转型动力灵活配置混合型证券投资基金、大成景明灵活配置混合型证券投资基金、富国中证银行指数分级证券投资基金、大成景穗灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信新能源汽车主题灵活配置混合型证券投资基金、英大灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金、南方改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金、大成景鹏灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信农业产业股票型证券投资基金、交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金 (LOF)、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、交银施罗德多策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安保本混合型证券投资基金、鹏华医药科技股票型证券投资基金、长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、大成深证成份交易型开放式指数证券投资基金、交银施罗德国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金、前海开源清洁能源主题精选灵活配置混合型证券投资基金、鹏华弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信中证申万医药

生物指数分级证券投资基金、易方达瑞享灵活配置混合型证券投资基金、中证 500 信息技术指数交易型开放式指数证券投资基金。

（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：钱巍

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>

(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：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

(3) 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

(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：杨菲

传真：（010）66105662

客服电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

(5) 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

(6) 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

(7) 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

(8) 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

(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：杨成茜

电话：(010)57092619

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

(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: 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

(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

(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: 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

(15) 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

(16) 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

(17) 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

(18) 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

(19) 申万宏源证券有限公司

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

(20) 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

(21) 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

(22) 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

(23) 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

(24) 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

(25) 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

(26) 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

(27) 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

(28) 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.csc.com.cn

(29) 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

(30) 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

(31) 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

(32) 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

(33) 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

(34) 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

(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: 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

(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: 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

(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

联系人: 马瑾

电话: (021) 20328720

客户服务电话：4006208888

公司网址：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) 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

(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

(43) 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

(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) 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

(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 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

(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：宋歌

电话：021-68778081

传真：021-68778117

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: 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

(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

(51) 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

(52) 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

(53) 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

(54) 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

(55) 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

(56) 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

(57) 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

(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： 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

(59) 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

(60) 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

(61) 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

(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 及 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

(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

(66) 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

(67) 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

(68) 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

(69) 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/>

(70) 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： 021-58787698

客服电话： 400-089-1289

公司网站： www.erichfund.com

(71) 上海好买基金销售有限公司有限公司

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

(72) 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：许建平

联系人：李巍

电话：010-88085858

传真：010-88085195

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

（73）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：021-33323830

客服热线：4008202819

公司网址：<http://www.chinapnr.com/>

（74）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

(75) 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

(76) 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

联系人：陈东

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服热线：4000-466-788

公司网址：<http://www.66zichan.com>

(77) 大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室

办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

联系人：朱真卿

电话：18616752315

传真：021-22268089

客服热线：021-22267943

公司网址：<http://www.dtfortune.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：钱巍

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：北京市君泽君律师事务所

住所：北京市西城区金融大街9号金融街中心南楼六层

办公地址：北京市西城区金融大街9号金融街中心南楼六层

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有限公司（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%。

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。

①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。

②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。

③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。具体按照以下流程进行替代成份股的筛选：

(1) 在中证新兴产业指数成份股中，筛选出被替代股票所在细分行业内的股票，作为替代成份股的备选池。

(2) 通过“东吴优化筛选模型”筛选相同行业成份股进行替代，以估计替代时间的长短，作为模型计算的时间区间：

(3) 使用东吴优化筛选系统计算出替代成份股的比例之后，由行业分析师对初选结果进行复议，从基本面角度考察用于替代的成分股是否合适用于替换目的，并酌情进行调整。

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。

(1) 跟踪误差

$$\text{跟踪误差} = \sqrt{\sum_{i=1}^n (r_i - \bar{r})^2 / (n-1)},$$

其中 r_i 表示第 i 日基金净值收益率-第 i 日基金业绩比较基准收益率；

$$\bar{r} = \sum_{i=1}^n r_i / n, \text{ n 为天数。}$$

(2) 跟踪偏离度

跟踪偏离度=前 n 日基金净值累计收益率-前 n 日基金业绩比较基准累计收益率

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创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2016年1月15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12月31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	151,677,771.94	92.60
	其中:股票	151,677,771.94	92.60
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	9,066,394.69	5.54
7	其他资产	3,053,392.05	1.86
8	合计	163,797,558.68	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	3,135,157.50	1.92
B	采矿业	4,360,554.71	2.67
C	制造业	104,264,561.72	63.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,268,164.61	4.45
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	23,274,752.99	14.26
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	3,036,965.74	1.86

0	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	4,677,949.60	2.87
S	综合	1,659,665.07	1.02
	合计	151,677,771.94	92.95

(2) 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票

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	002049	同方国芯	41,033	2,468,134.95	1.51
2	600718	东软集团	77,534	2,407,430.70	1.48
3	002450	康得新	60,787	2,315,984.70	1.42
4	600085	同仁堂	48,008	2,141,636.88	1.31
5	002202	金风科技	86,017	1,960,327.43	1.20
6	002292	奥飞动漫	36,731	1,899,360.01	1.16
7	000998	隆平高科	73,914	1,755,457.50	1.08
8	600436	片仔癀	24,883	1,711,701.57	1.05
9	002065	东华软件	67,963	1,705,871.30	1.05
10	600770	综艺股份	90,841	1,659,665.07	1.02

(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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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 期末其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	98,114.75
2	应收证券清算款	2,952,021.87
3	应收股利	-
4	应收利息	2,267.29
5	应收申购款	988.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,053,392.05

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

（5）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

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	002049	同方国芯	2,468,134.95	1.51	重大资产重组
2	002065	东华软件	1,705,871.30	1.05	临时停牌

（6）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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

（7）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。

(1) 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

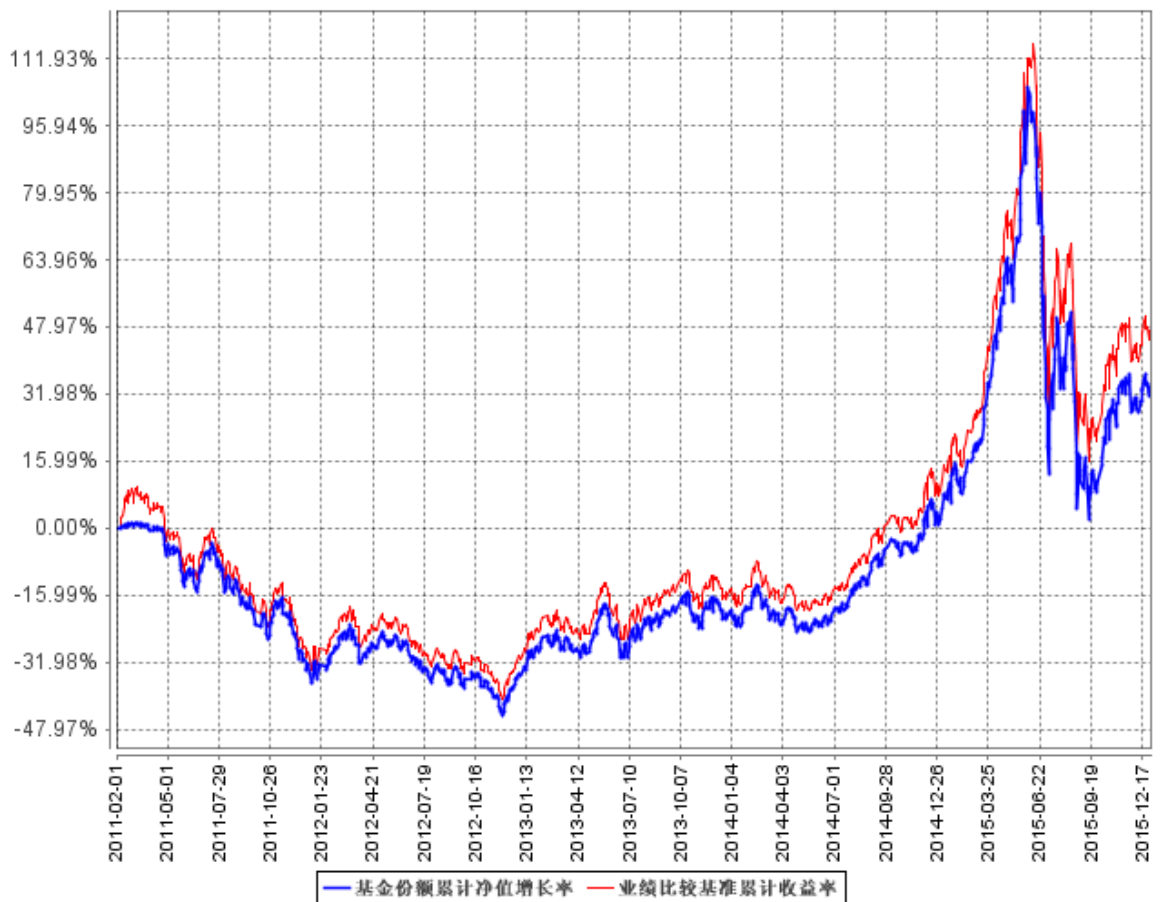
时间	净值增长率 ①	净值增长率 标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
2011.02.01-2011.12.31	-32.70%	1.27%	-29.54%	1.40%	-3.16%	-0.13%
2012.01.01-2012.12.31	-2.82%	1.40%	-1.30%	1.40%	-1.52%	0.00%
2013.01.01-2013.12.31	15.58%	1.64%	8.83%	0.96%	6.75%	0.68%
2014.01.01-2014.12.31	27.50%	1.14%	28.22%	1.15%	-0.72%	-0.01%
2015.01.01-2015.12.31	29.61%	2.89%	33.57%	2.72%	-3.96%	0.17%
2011.02.01-2015.12.31	32.2%	1.76%	45.6%	1.73%	-13.4%	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2015年12月31日。

(2) 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2015年12月31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：东吴中证新兴产业指数基金于 2011 年 2 月 1 日成立。

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）、东吴创新创业混合型证券投资基金（基金代码：580007）、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）、东吴新兴产业精选混合型证券投资基金（580008）、东吴配置优化混合型证券投资基金（基金代

码：582003）及东吴内需增长混合型证券投资基金（580009）、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）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、中信银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、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、申万宏源证券有限责任公司、民生银行股份有限公司、邮政储蓄银行有限责任公司、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、天相投资顾问有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、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、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、兴业证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、东方证券有限责任公司、长城证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、南京证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、世纪证券有限责任公司、中航证券有限公司、广发华福证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、财富证券有限公司、广州证券有限责任公司、厦门证券有限责任公司、中信证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司、中银国际证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、财富里昂证券有限责任公司、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、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、浙江金观诚财富管理有限公司、联泰资产管理有限公司、大泰金石资产管理有限公司。。

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規规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法規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：

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

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

本基金转换费率由基金管理人届时另行规定。”

（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》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“九、基金的投资”中，更新了相关内容。
- 7、在“十、基金的业绩”中，更新了相关内容。
- 8、在“二十二、其他应披露事项”中，增加了其他披露事项：

(1) 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》;

(2) 2015 年 08 月 27 日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴中证新兴产业指数证券投资基金 2015 年半年度报告以及摘要》;

(3) 2015 年 09 月 14 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴中证新兴产业指数证券投资基金招募说明书以及摘要更新》;

(4) 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》;

(5) 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》;

(6) 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》;

(7) 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》;

(8) 2015 年 10 月 26 日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴中证新兴产业指数证券投资基金 2015 年第 3 季度报告》;

(9) 2015 年 10 月 27 日在上海证券报、中国证券报、证券时报、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证券投资基金估值方法变更的公告》;

(10) 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》;

(11) 2015 年 12 月 09 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浙江金观诚财富管理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》;

(12) 2015 年 12 月 09 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浙江金观诚财富管理有限公司申购费率及定投申购费率优惠的公告》;

(13) 2015 年 12 月 18 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邮政储蓄银行股份有限公司个人网上银行和手机银行基金申购费率优惠的公告》;

(14)2015年12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旗下基金新增上海陆金所资产管理有限公司为代销机构公告》;

(15)2015年12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上海陆金所资产管理有限公司费率优惠的公告》;

(16)2015年12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《东吴基金关于参加浙江金观诚财富管理有限公司费率优惠活动的公告》;

(17) 2015年12月31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指数熔断情况下旗下基金调整开放时间的公告》;

(18) 2015年12月31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定投产品费率优惠的公告》;

(19) 2016年01月04日在中国证券报、上海证券报、证券时报、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银行股份有限公司基金代销业务费率优惠活动的公告》;

(20) 2016年01月04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苏州银行股份有限公司申购及定期定额申购费率优惠活动的公告》;

(21) 2016年01月04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 年年度资产净值公告》;

(22) 2016年01月12日在中国证券报、上海证券报、证券时报、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证券投资基金估值方法变更的公告》;

(23) 2016年01月13日在中国证券报、上海证券报、证券时报、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证券投资基金估值方法变更的公告》;

(24) 2016年01月16日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于公司董事长变更的公告》;

(25) 2016年01月16日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所（巨潮资讯网）等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于公司总经理变更的公告》;

(26) 2016年01月20日在上海证券报、中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴中证新兴产业指数证券投资基金 2015 年第 4 季度报告》;

(27) 2016 年 01 月 21 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大泰金石投资管理有限公司为代销机构并推出转换业务的公告》;

(28) 2016 年 01 月 21 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大泰金石投资管理有限公司费率优惠的公告》;

(29) 2016 年 01 月 21 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联泰资产管理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》;

(30) 2016 年 01 月 21 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联泰资产管理有限公司费率优惠的公告》;

(31) 2016 年 01 月 28 日在中国证券报、上海证券报、证券时报、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证券投资基金估值方法变更的公告》。

十六、签署日期

本基金更新招募说明书于2016年3月17日签署。

东吴基金管理有限公司
二零一六年三月十七日