

# 东吴深证 100 指数增强型证券投资基金

## 更新招募说明书摘要

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

### 重要提示

本基金根据【2011】年【8】月【12】日中国证券监督管理委员会《关于同意东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）募集的批复》（证监基金字【2011】【1278】号）的核准，进行募集。

基金管理人保证《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）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。

本基金于 2012 年 3 月 9 日得到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。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，基金运作风险等等。此外，本基金以 1 元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在单位份额净值跌破 1 元初始面值的风险。

基金投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资者有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资者

投资于本基金时应认真阅读本《招募说明书》。全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2015 年 9 月 9 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2015 年 6 月 30 日(财务数据未经审计)。

## 一、绪言

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》)、《公开募集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》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 5 号<招募说明书的内容与格式>》等有关法律法规以及《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,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。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。

## 二、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：任少华
- 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【2003】82 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。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混合型证券投资基金，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混合型证券投资基金，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混合型证券投资基金，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混合型证券投资基金，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混合型证券投资基金，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

行股份有限公司。公司已管理的第十三只产品东吴保本混合型证券投资基金，于 2012 年 8 月 13 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第十四只产品东吴内需增长混合型证券投资基金，于 2013 年 1 月 30 日基金合同生效，托管行为交通银行股份有限公司。公司已管理的第十五只产品东吴鼎利分级债券型证券投资基金，于 2013 年 4 月 25 日基金合同生效，托管行为交通银行股份有限公司。公司已管理的第十六只产品东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金，于 2014 年 3 月 19 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第十七只产品东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金，于 2014 年 5 月 9 日基金合同生效，托管行为平安银行股份有限公司。公司已管理的第十八只产品东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金，于 2015 年 5 月 27 日基金合同生效，托管行为平安银行股份有限公司。公司已管理的第十九只产品东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金，于 2015 年 7 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。

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

吴永敏先生，董事长，硕士研究生，高级审计师、高级经济师，中共党员。历任苏州市财政局科员、苏州市税务局副科长、苏州市税务局三分局局长、苏州市税务局科长、苏州市审计局副局长，东吴证券股份有限公司董事长、党委书记，现任东吴基金管理有限公司董事长。

陈辉峰先生，副董事长，硕士研究生，高级国际商务师，中共党员。历任上海轻工国际（集团）有限公司五金分公司总经理、上海轻工国际发展有限公司副总经理、上海兰生股份有限公司常务副总经理、总经理、上海兰生（集团）有限公司营运管理部总经理。现任上海东浩兰生国际服务贸易（集团）有限公司投资发展部总经理。

任少华先生，董事，博士研究生，经济师，中共党员。历任苏州市人民检察院助理检查员，苏州中辰期货公司总经理助理，苏州证券投资部总经理、资产管理部总经理、副总经济师，东吴证券股份有限公司资产管理总部总经理、总经济师、总裁助理兼任期货筹备组组长、研究所所长，东吴证券股份有限公司党委委员、副总裁，东吴期货有限公司董事长。现任东吴基金管理有限公司总经理。

冯恂女士，董事，博士研究生，经济师，中共党员。历任东吴证券研究所研究员，国联证券研究所所长、总裁助理兼经管总部总经理、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。

全卓伟女士，董事，硕士研究生，历任上海市国有资产监督管理委员会综合处、规划发展处副主任科员、主任科员，企业改革处副处长。现任上海东浩兰生国际服务贸易（集团）有限公司资本运营部副总经理、上海东浩资产经营有限公司副总经理。

王炯先生，职工董事，硕士研究生、经济师，中共党员。历任苏州市统计局综合平衡处科员，东吴证券总裁办公室主任、机构客户部总经理、总裁助理。现任东吴基金管理有限公司常务副总经理。

贝政新先生，独立董事，大学，教授，博士生导师。历任苏州大学商学院财经学院讲师、副教授。现任苏州大学商学院财经学院教授。

袁勇志先生，独立董事，教授，博士生导师。历任苏州大学管理学院教师、苏州大学人文社科处处长、苏州大学党委研究生工作部部长，现任苏州大学出版社副总编。

陈如奇先生，独立董事，大专学历，中共党员，高级经济师。历任新疆人民银行巴州中心支行科员，新疆农业银行巴州及自治区分行科长、处长，交通银行上海分行处长、副行长，交通银行广州分行行长，交通银行香港分行总经理等职。

## 2、监事会成员

顾锡康先生，监事会主席，硕士学位，高级工程师、经济师，中共党员。历任苏州电子计算机厂工程师、室主任，苏州人民银行科技科硬件组组长，苏州证券电脑中心经理、技术总监，东吴证券技术总监兼信息技术总部总经理，东吴证券股份有限公司合规总监、监事会主席。

王菁女士，监事，本科学士学位，会计师，中共党员。历任东吴证券经纪分公司财务经理、东吴证券财务部总经理助理、副总经理，现任东吴证券股份有限公司财务部总经理。

沈清韵，员工监事，本科，学士学位，中共党员。历任普华永道中天会计师事务所高级审计员，东吴基金管理有限公司监察稽核部副总经理，现任监察稽核部总经理兼风险管理部总经理。

## 3、高管人员

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）

王炯先生，常务副总经理、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、苏州证券西北街营业部业务主管、东吴证券办公室副主任、总裁办公室主任、机构客户部总经理、总裁助理等职务，现任东吴基金管理有限公司常务副总经理。

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，8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

唐祝益 2012 年 03 月 09 日-2013 年 06 月 05 日

刘元海 2012 年 03 月 14 日-2013 年 06 月 05 日

#### 5、投资决策委员会成员

任少华 公司总经理；

杨庆定 基金投资总部总经理；

陈宪 研究策划部总经理；

戴斌 基金投资总部副总经理；

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。

### 三、基金托管人

#### （一）基金托管人情况

##### 1.基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：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

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010)67595096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。中国建设银行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。于 2014 年末，中国建设银行市值约为 2,079 亿

美元，居全球上市银行第四位。

于 2014 年末，本集团资产总额 167,441.30 亿元，较上年增长 8.99%；客户贷款和垫款总额 94,745.23 亿元，增长 10.30%；客户存款总额 128,986.75 亿元，增长 5.53%。营业收入 5,704.70 亿元，较上年增长 12.16%；其中，利息净收入增长 12.28%，净利息收益率(NIM)2.80%；手续费及佣金净收入占营业收入比重为 19.02%；成本收入比为 28.85%。利润总额 2,990.86 亿元，较上年增长 6.89%；净利润 2,282.47 亿元，增长 6.10%。资本充足率 14.87%，不良贷款率 1.19%，拨备覆盖率 222.33%。

客户基础进一步夯实，全年公司机构有效客户和单位人民币结算账户分别新增 11 万户和 68 万户，个人有效客户新增 1,188 万户。网点“三综合”覆盖面进一步扩大，综合性网点达到 1.37 万个，综合柜员占比达到 80%，综合营销团队 1.75 万个，网点功能逐步向客户营销平台、体验平台和产品展示平台转变。深化网点柜面业务前后台分离，全行超过 1.45 万个营业网点 30 类柜面实时性业务产品实现总行集中处理，处理效率提高 60%。总分行之间、总分行与子公司之间、境内外以及各分行之间的业务联动和交叉营销取得重要进展，集团综合性、多功能优势逐步显现。

债务融资工具累计承销 3,989.83 亿元，承销额连续四年同业排名第一。以“养颐”为主品牌的养老金融产品体系进一步丰富，养老金受托资产规模、账户管理规模分别新增 188.32 亿元和 62.34 万户。投资托管业务规模增幅 38.06%，新增证券投资基金托管只数和首发份额市场领先。跨境人民币客户数突破 1 万个、结算量达 1.46 万亿元。信用卡累计发卡量 6,593 万张，消费交易额 16,580.81 亿元，多项核心指标同业第一。私人银行业务持续推进，客户数量增长 14.18%，金融资产增长 18.21%。

2014 年，本集团各方面良好表现，得到市场与业界广泛认可，先后荣获国内外知名机构授予的 100 余项重要奖项。在英国《银行家》杂志 2014 年“世界银行 1000 强排名”中，以一级资本总额位列全球第 2；在英国《金融时报》全球 500 强排名第 29 位，新兴市场 500 强排名第 3 位；在美国《福布斯》杂志 2014 年全球上市公司 2000 强排名中位列第 2；在美国《财富》杂志世界 500 强排名第 38 位。此外，本集团还荣获国内外重要媒体评出的诸多重要奖项，覆盖公司治理、社会责任、风险管理、公司信贷、零售业务、投资托管、债券承销、信用卡、住房金融和信息技术等多个领域。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等 9 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## 2.主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力争，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## 3.基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2015年6月末，中国建设银行已托管514只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”；获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖；境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖；中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

### **(二) 基金托管人的内部控制制度**

#### 1.内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行

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

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

## 3.内部控制制度及措施

投资托管业务部具备系统、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；业务管理严格实行复核、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**

#### 1.监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### 2.监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 四、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

注册地址：上海市源深路 279 号

办公地址：上海市源深路 279 号

法定代表人：任少华

传真：021-50509884

联系人：钱巍

客户服务电话：400—821—0588（免长途话费）、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：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](http://www.abchina.com)

##### (2) 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](http://www.icbc.com.cn)

##### (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) 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

(5) 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

(6) 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

(7) 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>

（8）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](http://www.cmbc.com.cn)

（9）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](http://www.nbc.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

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

（11）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)

（12）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](http://www.jsbchina.cn)

（13）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](http://www.dwzq.com.cn)

（14）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)

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

(16) 申万宏源证券有限公司

英文名称：Shenwan Hongyuan Securities Co., Ltd.

注册资本：人民币 330 亿元

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）

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

国际互联网网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

联系人：黄莹

(17) 申万宏源（西部）证券有限公司

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

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室（邮编：830002）

法定代表人：许建平

电话：010-88085858

传真：010-88085195 客户服务电话：400-800-0562

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

联系人：李巍

(18) 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](http://www.csc108.com)

（19）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：广东省广州天河区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](http://www.gf.com.cn)

（20）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦6层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客服电话：95536

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

（21）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)

（22）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)

(23) 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

(24) 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](http://www.jyzq.com.cn)

(25) 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)

(26) 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](http://www.htsc.com.cn)

(27) 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)

(28) 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)

(29) 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 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

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：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客服电话： 95548

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

（30）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](http://www.ebscn.com)

（31）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](http://www.bhzq.com)

（32）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](http://www.bocichina.com)

（33）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](http://www.newone.com.cn)

(34) 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](http://www.qlzq.com.cn)

(35) 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](http://www.cnht.com.cn)

(36) 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)

(37) 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](http://www.longone.com.cn)

（38）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)

（39）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](http://www.ajzq.com)

（40）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](http://www.jjm.com.cn)

(41) 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](http://www.cnhbstock.com)

(42) 平安证券有限责任公司

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

联系人：吴琼

电话：0755-22621866

传真：0755-82400862

客服热线：95511-8

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

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

(44) 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)

（45）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](http://www.cindasc.com)

（46）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](http://www.hazq.com)

（47）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)

（48）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](http://www.gzs.com.cn)

（49）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：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)

（50）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)

（51）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](http://www.wkzq.com.cn)

（52）九州证券有限公司

注册地址：青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼

办公地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦18楼

法定代表人：林小明

联系人：聂晗

电话：0755-33331188

传真：0755-33329815

客服热线：4006543218

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

（53）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](http://www.cf-clsa.com)

（54）中信证券（浙江）有限责任公司

住所：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

办公地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

法定代表人：沈强

电话：0571-86078823

传真：0571-85783711

联系人：周妍

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

客户服务电话：0571-96598

（55）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](http://www.wlzq.com.cn)

（56）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)

（57）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)

（58）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](http://www.ghzq.com.cn)

（59）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.gjq.com.cn](http://www.gjq.com.cn)

(60) 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](http://www.5ifund.com)

(61) 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](http://www.noah-fund.com)

(62) 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](http://www.1234567.com.cn)

(63) 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

（64）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/>

（65）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](http://www.erichfund.com)

（66）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：021-20613999

传真：021-68596916

客服热线：400-700-9665

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

3、基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

## （二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司  
住所：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层  
法定代表人：金颖  
办公地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层  
联系电话：010-58598853  
传真：010-58598907  
联系人：任瑞新

### **（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6层  
办公地址：北京市西城区金融大街9号金融街中心南楼6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：天衡会计师事务所  
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

## **五、基金的名称**

本基金名称：东吴深证 100 指数增强型证券投资基金

## **六、基金的类型**

基金的类别：股票型基金。

## **七、基金的投资目标**

本基金为股票型指数增强基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过指数增强策略进

行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。

## 八、基金的投资范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括投资于国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证以及经中国证监会批准允许本基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

## 九、基金的投资策略

本基金主要采用指数复制的方法拟合、跟踪深证 100 价格指数，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，本基金还将通过指数增强策略进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

### 1、资产配置策略

本基金为股票型指数增强基金，股票投资比例为基金资产的 90%-95%，其中深证 100 价格指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 80%。本基金还将根据投资研究团队对宏观经济运行态势、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，在本基金的投资范围内进行适度动态调整股票和债券等资产的配置比例，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

### 2、股票投资策略

本基金股票资产投资采用指数增强复制策略，即根据深证 100 价格指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整；同时，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，辅以量化增强策略等辅助增强策略，以期达到增强收益的目的。

#### (1) 跟踪标的的选择

本基金选择深证 100 价格指数作为跟踪标的指数。

深证 100 价格指数由深圳证券信息有限公司编制并发布，该指数选取在深圳证券交易所中上市的 100 只 A 股作为成份股，采用派氏加权法编制，其成份股票代表了深圳市场中 A 股市场的核心优质资

产，具有代表性强、流动性高的特点，能够反映深圳 A 股市场的总体发展趋势。

## （2）股票投资组合的构建

本基金在初始建仓期或者为申购资金建仓时，按照深证 100 价格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。

## （3）股票投资组合的调整

### ①定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的深证 100 价格指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。

### ②不定期调整

当深证 100 价格指数成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据指数公司在股权变动公告日次日发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整；

### ③特殊情形下的调整

本基金在某些特殊情形下将选择其他股票或股票组合对目标指数中的成份股票加以替换，这些情形包括：**a)**法律法规的限制；**b)**目标指数成份股流动性严重不足；**c)**成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼等。本基金进行替换遵循以下原则：**a)**用于替换的股票与被替换的股票属于同一行业，经营业务相似度高；**b)**用于替换的股票与被替换的股票的市场价格收益表现具有很强的相关性，能较好地代表被替换股票的收益表现；**c)**用于替换的股票优先从目标指数的其他成份股中挑选，如不能挑选出较合适的替换股票，再考虑从非目标指数成份股的股票中挑选。

## （4）指数增强策略

本基金的增强型策略主要包括：成分股量化增强策略和非成分股增强策略。

### a) 成分股量化增强策略

本基金成分股量化增强策略采用东吴多因子量化增强策略，主要方法为选取价值、成长、盈利、市场特征四大类因子，建立 Alpha 多因子模型。大类因子由一系列单因子组成，其中价值因子主要是指股票的绝对和相对估值水平，包括市盈率、市净率、市销率、EV/EBITDA 等指标；成长因子主要包括上市公司主营业务收入、现金流、净利润等指标的历史增长和预测增长；盈利因子主要包括上市公司毛利率、净利润率、净资产收益率等指标的绝对和相对水平；市场特征因子主要包括股票价格的动量/反转趋势、股票的规模因子以及其他风格因子。上述因子能够综合反映股票市场的诸多驱动因素，能够寻找较好的投资机会。

通过东吴多因子量化增强策略，本基金对深证 100 价格指数成分股进行综合评分，并根据评分结果，在严格控制跟踪误差的前提下，对深证 100 价格指数成分股进行权重优化，作为指数增强投资中的参考。

### b) 非成分股增强策略

对于非成分股的选择，本基金采用“东吴基金企业竞争优势评价体系”，即投研团队根据波特的五种竞争力模型，深入分析上市公司的战略管理优势、技术优势、市场优势、管理运营优势、资源及其它附加优势，采用定性的方法得到上市公司竞争优势的评价。本基金在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，适度投资于上述优选的非成分股上市公司股票，以期达到增强收益的目的。

本基金还可投资预期将纳入指数的个股，以及新股发行、增发或配股在内的具有重大投资机会的股票，以增强基金的投资收益。

#### (5) 跟踪误差控制

本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使得基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。

本基金将密切跟踪基金的实际跟踪误差，及时分析跟踪误差的来源，调整基金投资组合，将跟踪误差控制在跟踪目标以内。

### 3、债券投资策略

本基金债券投资主要是流动性管理的需要，以获取适当收益。本基金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。基金管理人将优先选择信用等级较高、剩余期限较短、流动性较好的政府债券进行投资，并通过对基金现金需求的科学分析，制定相应的债券投资策略，合理分配基金资产在债券上的配置比例。

## 十、基金的业绩比较基准

基金业绩比较基准=95%\*深证 100 价格指数收益率 +5%\*商业银行活期存款利率（税后）

## 十一、基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

## 十二、基金投资组合报告

东吴深证 100 指数增强证券投资基金(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建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2015 年 7 月 16 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 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	18,170,092.07	92.41
	其中：股票	18,170,092.07	92.41
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	1,246,568.68	6.34
7	其他资产	244,762.23	1.24
8	合计	19,661,422.98	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	33,592.00	0.17
B	采矿业	326,226.90	1.70
C	制造业	10,301,286.69	53.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	84,924.18	0.44
E	建筑业	160,344.72	0.83
F	批发和零售业	379,660.22	1.98
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	1,117,160.69	5.82
J	金融业	1,916,635.34	9.98
K	房地产业	1,436,201.99	7.48
L	租赁和商务服务业	332,679.58	1.73
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	509,923.85	2.66
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	397,909.02	2.07
S	综合	111,103.72	0.58
	合计	17,107,648.90	89.08

(2) 报告期末积极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	-	-
B	采掘业	38,099.88	0.20
C	制造业	437,851.27	2.28

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,868.28	0.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	24,661.24	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	63,783.72	0.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,585.57	0.30
J	金融业	143,031.39	0.74
K	房地产业	33,495.00	0.17
L	租赁和商务服务业	147,009.90	0.77
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	43,260.66	0.23
R	文化、体育和娱乐业	50,796.26	0.26
S	综合	-	-
	合计	1,062,443.17	5.53

### 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	000651	格力电器	11,916	761,432.40	3.97
2	000024	招商地产	16,823	614,039.50	3.20
3	000002	万科A	36,666	532,390.32	2.77
4	000709	河北钢铁	62,794	439,558.00	2.29
5	000783	长江证券	30,795	429,590.25	2.24
6	000001	平安银行	28,817	418,999.18	2.18
7	000625	长安汽车	18,638	394,193.70	2.05
8	000630	铜陵有色	37,230	384,213.60	2.00
9	000333	美的集团	10,000	372,800.00	1.94
10	002415	海康威视	7,509	336,403.20	1.75

#### (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	601888	中国国旅	1,703	112,908.90	0.59
2	601006	大秦铁路	4,543	63,783.72	0.33
3	002153	石基信息	443	57,585.57	0.30
4	300005	探路者	2,005	54,937.00	0.29
5	600436	片仔癀	728	48,535.76	0.25

### 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

(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。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

(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。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

11、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未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、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) 期末其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	26,539.88
2	应收证券清算款	166,616.02
3	应收股利	-
4	应收利息	297.00
5	应收申购款	51,309.33

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	244,762.23

(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) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

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	000630	铜陵有色	384,213.60	2.00	重大事项停牌
2	000709	河北钢铁	439,558.00	2.29	重大事项停牌
3	000024	招商地产	614,039.50	3.20	重大事项停牌

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

(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。

### 十三、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。

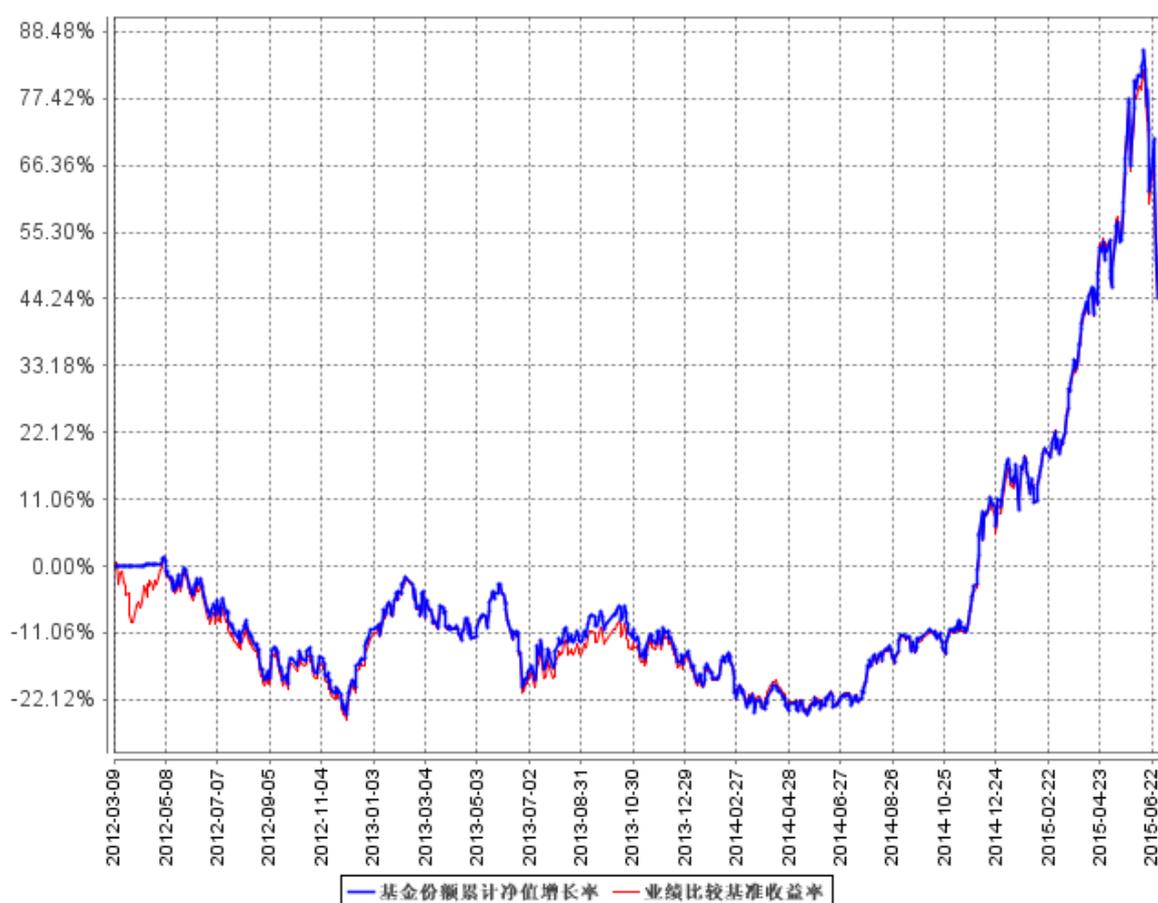
(1) 东吴深证 100 指数增强型证券投资基金历史时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较:

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
2012.03.09-2012.12.31	-10.40%	1.17%	-12.00%	1.30%	1.60%	-0.13%
2013.01.01-2013.12.31	-4.24%	1.34%	-4.64%	1.35%	0.40%	-0.01%
2014.01.01-2014.12.31	31.12%	1.14%	30.69%	1.15%	0.43%	-0.01%
2015.01.01-2015.06.30	36.27%	2.20%	37.97%	2.10%	-1.70%	0.10%
2012.03.09-2015.06.30	53.30%	1.41%	53.45%	1.42%	-0.15%	-0.01%

注:统计截至 2015 年 6 月 30 日,比较基准=95%\*深证 100 价格指数收益率+5%\*商业银行活期存款利率(税后)

(2) 东吴深证 100 指数增强型证券投资基金累计净值增长率历史走势图(2012 年 3 月 9 日至 2015 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：东吴深证100指数增强型证券投资基金从2012年3月9日起正式运作。

## 十四、基金费用与税收

### (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、基金上市费及年费；
- 9、基金的指数使用费；
- 10、基金的开户费用、账户维护费用；
- 11、在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

12、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 5 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：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，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 5 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、基金的指数使用费

本基金作为指数基金，需根据与指数所有人深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用费。通常情况下，指数使用费按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，且收取下限为每季度（《基金合同》生效之日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限）人民币 5 万元。计算方法如下：

$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$

H 为每日计提的指数使用费

E 为前一日基金资产净值

指数使用费从《基金合同》生效日开始每日计算，逐日累计。

指数使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于每季度结束后 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给深圳证券信息有限公司。

4、除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关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。基金合同生效前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。

**（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。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。**

#### **（六）场外申购费用和赎回费用**

##### 1、申购费用

本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

本基金申购费率如下：

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

##### 2、赎回费用

赎回费用由基金份额赎回人承担，赎回费的 25%归基金财产，其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。

本基金赎回费率如下：

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

基金管理人可以根据法律法规规定及基金合同调整费率或收费方式，最新的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。费率如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

#### **（七）场内申购费用和赎回费用**

1、本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

本基金申购费率如下：

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

2、投资人可将其持有的全部或部分基金份额赎回。赎回费用由基金份额赎回人承担，赎回费的25%归基金财产，其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。

场内赎回费率统一为0.5%。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### **(八)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“十一、基金的投资”中，更新了相关内容。
- 6、在“二十三、其他应披露事项”中，增加了其他披露事项：

(1) 2015年3月19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江苏银行股份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》；

(2) 2015年3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变更江苏银行股份有限公司上线代销旗下基金并推出定期定额业务及转换业务时间的公告》；

(3) 2015年3月25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》；

(4) 2015年3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调整交易所固定收益品种估值方法变更的公告》;

(5) 2015年3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《东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)2014年年度报告以及摘要》;

(6) 2015年3月30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继续参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告》;

(7) 2015年4月20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《东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)2015年第1季度报告》;

(8) 2015年4月22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《东吴深证100指数增强型证券投资基金更新招募说明书以及摘要》;

(9) 2015年5月6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》;

(10) 2015年5月29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》;

(11) 2015年5月29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中国农业银行股份有限公司网上银行、手机银行申购费率优惠的公告》;

(12) 2015年6月3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》;

(13) 2015年6月4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》;

(14) 2015年6月8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新增诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及参加柜台、网上交易申购费率优惠的公告》;

(15) 2015年6月12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好买基金销售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》;

(16) 2015年6月12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好买基金销售有限公司申购费率及定投申购费

率优惠的公告》;

(17) 2015年6月26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《关于东吴基金管理有限公司旗下基金参与深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告》;

(18) 2015年6月26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数米基金网费率优惠活动的公告》;

(19) 2015年6月26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浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告》;

(20) 2015年6月29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交通银行股份有限公司网上银行、手机银行延长基金申购费率优惠的公告》;

(21) 2015年6月30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证券投资基金估值方法变更的公告》;

(22) 2015年7月1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年半年度资产净值公告》;

(23) 2015年7月6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证券投资基金估值方法变更的公告》;

(24) 2015年7月7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》;

(25) 2015年7月7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在公司直销柜台开展申购费率优惠活动的公告》;

(26) 2015年7月7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公司及高管、基金经理投资旗下基金相关事宜公告》;

(27) 2015年7月8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》;

(28) 2015年7月9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》;

(29) 2015年7月16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》;

(30) 2015年7月21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

吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）2015 年第 2 季度报告》；

(31) 2015 年 8 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》；

(32) 2015 年 8 月 26 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》；

(33) 2015 年 8 月 27 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》；

(34) 2015 年 8 月 27 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《东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）2015 年半年度报告以及摘要》；

## 十六、签署日期

本基金更新招募说明书于2015年10月23日签署。

东吴基金管理有限公司  
二零一五年十月二十三日