

东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金

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：中国工商银行股份有限公司

重要提示

本基金根据 2004 年 11 月 25 日中国证券监督管理委员会《关于同意东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金募集的批复》（证监基金字[2004]201 号）的核准，进行募集。本基金的基金合同于 2005 年 2 月 1 日正式生效。

基金管理人保证《东吴嘉禾优势精选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。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2009 年 8 月 1 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2009 年 6 月 30 日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：东吴基金管理有限公司

住所：上海市源深路 279 号

设立日期：2004 年 9 月 2 日

法定代表人：徐建平

办公地址：上海市源深路 279 号

客户服务电话：021-50509666

联系人：徐远征

注册资本：人民币 10000 万元

股权结构：

持股单位	出资额(万元)	占总股本比例
东吴证券有限责任公司	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%

（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。历任无锡县长征企业会计，苏州市财政局科员、苏州市税务局副科长、苏州市税务局科长、苏州市税务局三分局局长、苏州市审计局副局长。现任东吴证券有限责任公司党委书记、董事长。

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、党总支书记。现任上海兰生（集团）有限公司总裁助理、投资管理部总经理。

徐建平先生，董事，大学，会计师，中共党员。历任张家港市财政局科长兼市房改办副主任，苏州证券有限责任公司张家港杨舍证券营业部总经理、公司总裁助理兼资产管理总部总经理，东吴证券有限责任公司副总裁。现任东吴基金管理有限公司总经理。

陆宏伟先生，董事，研究生，经济师，中共党员。历任江苏省计划经济委员会副科长，江苏省国际信托投资公司证券部经理，信泰证券有限公司董事、常务副总裁。现任江苏澄星实业集团有限公司常务副总裁。

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。现任东吴证券有限责任公司董事会秘书。

戴继雄先生，董事，硕士，副教授，中共党员。历任上海市虹口区吴淞路街道办事处办事员、上海财经大学会计学院教研室副主任、上海复星高科技（集团）有限公司财务、审计

副总监。现任上海兰生（集团）有限公司财务部总经理、财务副总监。

贝政新先生，独立董事，大学，教授。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，博士，研究员。现任中国社科院经济研究所研究员，兼职中央财经大学金融学院教授和江南信托经济学家。

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。现任光大证券有限责任公司独立董事。

2、监事会成员

马震亚先生，监事长，大学，会计师。历任苏州市审计局科员、副主任科员，苏州证券有限责任公司财务部总经理。现任东吴证券有限责任公司财务总监。

赵江先生，监事，大专，会计师。曾任中国船舶工业集团公司澄西船厂财务处会计科长，现任江阴澄星实业集团有限公司审计部经理、兼资产管理部经理。

王炯女士，员工监事，硕士学历。曾任大鹏证券研究所和投资部研究员、首席分析师助理、东吴基金管理有限公司基金经理助理等职，现任东吴基金管理有限公司投资总监，兼投资管理部总经理、东吴价值成长双动力基金基金经理、东吴进取策略灵活配置基金基金经理。

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）

徐建平先生，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月任东吴基金管理有限公司市场总监职务；现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

该基金历任基金经理及任职年限分别为：向朝勇，2005年2月至2006年9月；庞良永，2006年9月至2008年5月；魏立波，2008年1月至今。

现任基金经理：魏立波先生，男，1973年生，管理学硕士，九年证券业从业经历，曾担任东方证券股份有限公司高级研究员、东吴证券有限责任公司证券投资总部总经理助理和东吴基金管理有限公司基金经理助理等职，自2008年1月起担任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

徐建平 总经理；

胡玉杰 副总经理（债券投资）；

王 炯 投资总监，兼投资管理部总经理、基金经理；

黎 瑛 研究策划部总经理；

陈 宪 首席策略规划师。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

基金托管人名称：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

法定代表人：姜建清

成立时间：1984年1月1日

批准设立机关及批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币334,018,850,026元

存续期间：持续经营

经营情况：作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行着资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至2009年6月，托管证券投资基金127只，其中封闭式8只，开放式119只。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2009年初，中国工商银行先后被《环球金融》、《全球托管人》、《财资》和国内证券类年鉴《中国证券投资基金年鉴》及《证券时报》评选为2008年度“中国最佳托管银行”，自2004年以来，中国工商银行资产托管服务已经获得18项国内外大奖。

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: 徐远征

直销电话: (021) 50509880

传真: (021) 50509884

客户服务电话: (021) 50509666

网站: www.scfund.com.cn

2. 代销机构:

(1) 中国工商银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号 (100005)

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号 (100005)

法定代表人: 姜建清

联系人: 王隽

电话: (010) 66107900

传真: (010) 66017914

客服电话: 95588

网址: www.icbc.com.cn

(2) 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: 郭树清

联系人: 王琳

电话: (010) 67596084

传真：(010) 66218888

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

(3) 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：蒋浩

电话：(010) 68424199

传真：(010) 68424181

客服电话：95599

网址：www.abchina.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：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408842

联系人：曹榕

客服电话：95559

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：翟鸿祥

联系人：陈宇

电话：(010) 85238423

传真：(010) 85238680

客服电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

(6) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：孔丹

客服电话：95558

联系人：金蕾

电话：010-65557013

传真：010-65550827

网址：<http://bank.ecitic.com>

(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：秦晓

联系人：万丽

电话：(0755) 83198888

传真：(0755) 83195049

客服电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(8) 深圳发展银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：法兰克纽曼 (Frank Neil Newman)

联系人：周勤

电话：(0755) 8208888

传真：(0755) 82080386

客服电话：95501

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) 58351666

传真：(010) 83914283

客服电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

(10) 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

客户服务电话：95580

联系人：陈春林

传真：010-66415194

网址：www.psbc.com

(11) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号

办公地址：宁波市江东区中山东路 294 号

法定代表人：陆华裕

联系人：钱庚旺

电话：(021) 63586189

传真：(021) 63586215

客服电话：96528，上海地区 962528

网址: www.nbc.com.cn

(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

电话: 0755-25859591

传真: 0755-25879453

联系人: 霍兆龙

客户服务电话: 40066-99999 (免长途费) 或 0755-961202

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: 温州市车站大道华海广场 1 号楼

法定代表人: 夏瑞洲

电话: 0577-88995217

传真: 0577-88995217

联系人: 林波

客户服务电话: (0577) 96699

网址: www.wzbank.cn

(14) 东吴证券有限责任公司

注册地址: 江苏省苏州市十梓街 298 号

办公地址: 江苏省苏州市爱河桥 26 号

法定代表人: 吴永敏

电话: 0512-65581136

传真: 0512-65588021

联系人: 方晓丹

客服电话: 0512-96288

网址: www.dwjq.com.cn

(15) 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

电话: 021-23219000

传真: 021-23219100

联系人: 金芸、李笑鸣

客服电话: 021-95553

网址: www.htsec.com

(16) 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: 胡长生

电话: 010-66568047

传真: 010-66568536

联系人: 李洋

客服电话: 4008-888-888

网址: www.chinastock.com.cn

(17) 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

电话: 021-54033888

传真: 021-54038844

联系人: 邓寒冰

客服电话: 021-962505

网址: www.sw2000.com.cn

(18) 中信建投证券有限责任公司

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

客服电话: 400-8888-108

网址: www.csc108.com

(19) 广发证券股份有限公司

注册地址: 广东省广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址: 广东省广州市天河北路183号大都会广场18、19、36、38、41和42楼

法定代表人: 王志伟

电话: 020-87555888

传真: 020-87555305

联系人: 沈东燮

客服电话: 95575或致电各地营业网点

网址: www.gf.com.cn

(20) 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: 025-84579879

联系人: 樊昊

客服电话: 025-84579897

网址: www.htsc.com.cn

(21) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路99号标力大厦

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

电话：021-38565785

传真：021-68419867

联系人：杨盛芳、谢高得

客服电话：400-8888-123

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16-26层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833-2181

传真：0755-82133302

联系人：齐晓燕

客服电话：95536

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：上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能大厦

法定代表人：陈学荣

电话：021-68634518

传真：021-68865938

联系人：钟康莺

客服电话：400-888-1551

网址：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

电话：0755-83516094

传真：0755-83516199

联系人：高峰

客服电话：0755-82288968

网址：www.cc168.com.cn

(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

电话：0510-82831662

传真：0510-82833321

联系人：袁丽萍

客服电话：0510-82588168

网址：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：祝幼一

电话：(021) 62580818-213

传真：(021) 62674109

联系人：芮敏祺

客服电话：400-8888-666

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

电话：0755-83199511

传真：0755-83199545

联系人：刘军辉

客服电话：0755-83199511

网址：www.csc.com.cn

(28) 联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047 号深圳发展银行大厦10、24、25层

办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047 号深圳发展银行大厦10、24、25层

法定代表人：马昭明

电话：0755-82492000

联系人：盛宗凌

客服电话：400-8888-555

网址：www.lhzq.com

(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

电话：(0755) 83025022

传真：(0755) 83025625

联系人：张萍

客服电话：4008-888-228

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 21 层-29 层

法定代表人：王益民

联系人：吴宇

电话：021-63325888

传真：021-63326173

客户服务热线：021-962506

网站：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 楼

法定代表人：牛冠兴

联系人：李昕

电话：010-65778822-251

传真：010-65778825

客户服务热线：400-800-1001

网站：www.essence.com.cn

（32）江南证券责任有限公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路 291 号江西教育出版社六楼

法定代表人：姚江涛

联系人：余雅娜

电话：0791-6768763

传真：0791-6789414

客户服务热线：0791-6781119

网站：www.scstock.com

（33）财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

法定代表人：周晖

联系人：郭磊

电话：0731—4403360

传真：0731—4403330

客户服务热线：0731-4403350

网站：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：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

电话：(0532) 85022026

传真：(0532) 85022026

联系人：丁韶燕

客服电话：(0532) 96577

网站：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) 6881 6000

传真：(021) 6881 8550

联系人：刘晨

客服电话：1010-8998

网站：www.ebscn.com

(36) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市开发区第一大街 29 号

办公地址：天津市河西区宾水道 3 号

法定代表人：张志军

电话：022-28451861

传真：022-28451616

联系人：王兆权

客户服务电话：400-651-5988

公司网站：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：唐新宇

电话：(021) 68604866

传真：(021) 50372474

联系人：张静

客户服务电话：021-68604866

网站：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：黄健

客服电话：95565、400-8888-111

网站：www.newone.com.cn

（39） 齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路 128 号

办公地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

电话：(0531) 81283728

传真：(0531) 81283735

联系人：傅咏梅

客服电话：95538

网站：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新华东街 111 号

法定代表人：刘汝军

电话：0471-4913998

传真：0471-4930707

联系人：常向东

客服电话：0471-4961259

网站：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：0551-2207936

传真：0551-2207965

联系人：程维

客服电话：95578

网站：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

电话：025-83364032

传真：025-83320066

联系人：胥春阳

客服电话：400-828-5888

网站： 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 59 号投资广场 18 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1589 号长泰国际金融大厦 11 楼

法定代表人：朱科敏

电话：021-50586660-8966

传真：021-50819897

联系人：李涛

客户服务热线：021-52574550 0519-88166222 0379-64902266

免费服务热线：400-888-8588

网站：www.longone.com.cn

（44）中国建银投资证券有限责任公司

注册地址：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心 48-50 层

办公地址：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心 48-50 层

法定代表人：杨小阳

电话：0755-82026521

传真：0755-82026539

联系人：刘权

客户服务热线：400-600-8008

网站：www.cjis.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 24 楼

办公地址：上海市南京西路 758 号 24 楼

法定代表人：张建华

电话：021-32229888

联系人：颜奕斌

客户服务热线：021-63340678

网站：www.ajzq.com

(46) 华宝证券经纪有限责任公司

注册地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 层

办公地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 层

法定代表人：陈林

电话：(021) 50122222

传真：(021) 50122200

联系人：严俊权

客户服务电话：(021) 38929908

网址：www.cnhbstock.com

(47) 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

电话：021-63219781

传真：021-51062920

联系人：李良

客户服务热线：4008-888-999 或 027-85808318

网站：www.95579.com

(48) 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

法定代表人：林义相

联系人：莫晓丽

电话：010-66045529

传真：010-66045500

网站：www.txsec.com

(二) 注册登记机构：东吴基金管理有限公司

注册地址：上海市源深路 279 号

办公地址：上海市源深路 279 号

法定代表人：徐建平

客户服务电话：021-50509666

传真：021-50509884

联系人：徐远征

(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：东吴嘉禾优势精选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

分享中国经济成长，以中低风险水平获得中长期较高收益。

本基金通过个股精选、科学的操作策略及严密的风险控制等手段来降低投资风险，力争将本基金的风险水平控制在比较基准的一定幅度范围内；同时，本基金通过对中国经济成长规律的准确把握和对具有价值成长比较优势股票的前瞻性投资来分享中国经济成长，获得中长期较高收益。

七、基金的投资方向

本基金投资范围为法律法规允许基金投资的具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。具体比例范围为：30%-95%的基金资产投资股票，投资债券资产不高于基金资产的 60%，现金类资产最低比例为 5%。基金股票资产的 80%以上投资于三重比较优势选股模型选出的股票。

八、基金的投资策略

在资产配置上，本基金根据各类别资产风险收益水平及本基金风险收益目标，确定大类资产配置比例。在平衡风险收益基础上，把握优势成长，追求中长期较高收益。在股票选择上，本基金根据个股在行业、企业、价格三方面比较优势的分析，精选出具有行业、企业、价格三重比较优势及具有企业、价格两重比较优势的个股作为投资对象。在股票具体操作策略上，将根据经济增长周期、行业生命周期及企业生命周期规律在中长时间段上进行周期持有，同时根据指数及个股运行的时空和量价效应进行中短时间段上的波段操作。

1、资产配置策略：平衡风险收益、把握优势成长

本基金资产配置的重点首先是研究影响资本市场各项因素的变化趋势，并对各项因素发生重大变化的拐点进行预测和把握，从而把握资本各细分市场的风险收益变化趋势。在此基础上，再根据本基金的风险收益目标动态平衡与优化股票、债券及现金类资产的配置比例。

本基金在平衡风险收益基础上，更重要的是要体现出本基金在风险收益目标上的追求，那就是把握优势成长。

2、个股精选策略：三重比较优势选股模型选股

（1）根据东吴优势行业综合评价模型，确定东吴优势行业、一般行业和弱势行业

本基金根据对行业竞争优势和成长能力的研究分析，结合国际竞争力及其它因素的优化，构建了从定量与定性两方面相结合的东吴优势行业综合评价模型，并根据该模型确定东

吴优势行业、一般行业和弱势行业。

(2) 根据东吴企业竞争优势综合评价模型，构建东吴企业比较优势备选股票库

第一步，从企业盈利能力、成长能力、资产质量以及企业规模四方面构建出东吴企业财务评价指标体系，分行业评价上市公司价值创造结果并排序，并分行业按一定比例对上市公司进行初选。第二步，根据波特的五种竞争力模型和价值链分析内容、以及企业能力理论和企业资源理论等，构建出东吴企业竞争优势评价体系，分行业综合评价上市公司竞争优势和未来成长能力，并根据上市公司竞争优势综合评分结果对根据东吴企业财务评价体系初选结果进行排序，选取东吴优势行业前 40%、一般行业前 20%、弱势行业前 10% 的上市公司股票作为东吴企业比较优势备选股票库。

(3) 根据东吴 EVA 价格比较优势选股模型，构建东吴价格比较优势备选股票库

第一步，建立以 EVA 为基础的价格比较优势选股模型；第二步，根据本基金 EVA 模型计算出上市公司的价值；第三步，比较股票价格与价值的相对差距，并按相对差距分行业进行由小到大的排序；第四步，选取东吴优势行业前 40%、一般行业前 20%、弱势行业前 10% 的上市公司股票作为东吴价格比较优势备选股票库。

(4) 本基金股票池构建

取东吴企业比较优势备选股票库和东吴价格比较优势备选股票库交集中属于优势行业部分的股票作为本基金股票池主要备选股票库。取东吴企业比较优势备选股票库和东吴价格比较优势备选股票库交集中属于一般行业或弱势行业的股票作为本基金股票池补充备选股票库。东吴嘉禾优势精选基金股票池分不同层面的选股模型按不同时间周期分别进行调整。

3、股票操作策略：周期持有、波段操作

在股票具体操作策略上，本基金将根据经济增长周期、行业生命周期及企业生命周期规律在中长时间段上进行周期持有证券资产，同时根据指数及个股运行的时空和量价效应进行中短时间段上的波段操作。

4、债券投资策略

作为混合型基金，本基金也非常重视对债券投资机会的把握。在债券品种选择上，本基金遵循相对价值原则和流动性原则。

债券资产品种配置的依据为不同品种之间的风险收益水平，配置方法根据利率变动情况分别考虑杠铃型、纺锤型等组合方法，同时考虑动态控制和调整组合的久期；可转债品种配置将综合考虑市场容量、条款对价格的影响等因素。

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%*（60%*上证 180 指数+40%*深证 100 指数）+35%*中信标普全债指数。

十、基金的风险收益特征

本基金定位于中低风险水平，力求通过选股方法、投资策略等，谋求中长期较高收益。

十一、基金的投资组合报告

东吴嘉禾优势精选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工商银行根据本基金合同规定,于 2009 年 7 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。

1、截至 2009 年 6 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	权益类投资	1,572,990,653.30	53.70
	其中：股票	1,572,990,653.30	53.70
2	固定收益类投资	144,957,000.00	4.95
	其中：债券	144,957,000.00	4.95
	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	1,201,240,440.10	41.01
6	其他资产	10,212,872.17	0.35
	合计	2,929,400,965.57	100.00

2、截至 2009 年 6 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	53,723,714.67	1.85
B	采掘业	49,556,081.52	1.70
C	制造业	674,148,634.73	23.16
C0	食品、饮料	128,707,833.20	4.42
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	99,499,644.25	3.42
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	37,754,960.40	1.30
C7	机械、设备、仪表	331,432,006.07	11.39
C8	医药、生物制品	39,885,124.85	1.37
C99	其他制造业	36,869,065.96	1.27
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	41,615,717.28	1.43
F	交通运输、仓储业	81,079,900.60	2.79
G	信息技术业	144,292,114.68	4.96
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	234,045,857.44	8.04
J	房地产业	203,821,420.75	7.00
K	社会服务业	5,842,162.83	0.20
L	传播与文化产业	30,634,959.04	1.05
M	综合类	54,230,089.76	1.86
	合计	1,572,990,653.30	54.04

3、截至 2009 年 6 月 30 日按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细：

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	600000	浦发银行	3,486,088	80,249,745.76	2.76
2	600048	保利地产	2,701,307	75,339,452.23	2.59
3	601318	中国平安	1,500,000	74,190,000.00	2.55
4	000024	招商地产	1,920,046	60,961,460.50	2.09
5	600089	特变电工	3,204,911	57,816,594.44	1.99
6	600415	小商品城	1,318,184	54,230,089.76	1.86
7	000407	胜利股份	5,598,079	51,222,422.85	1.76
8	601333	广深铁路	10,005,460	51,127,900.60	1.76

9	600348	国阳新能	1,632,282	49,556,081.52	1.70
10	000858	五粮液	2,500,000	49,325,000.00	1.69

4、截至 2009 年 6 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	144,957,000.00	4.98
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	可转债	-	-
7	其他	-	-
	合计	144,957,000.00	4.98

5、截至 2009 年 6 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	0801092	08 央票 92	800,000	77,152,000.00	2.65
2	080110	08 央票 104	400,000	38,660,000.00	1.33
3	0801112	08 央票 112	300,000	29,145,000.00	1.00

6、截至 2009 年 6 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：

本基金报告期期末未持有资产支持证券。

7、截至 2009 年 6 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：

本基金报告期期末未持有权证。

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。

（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) 报告期末未持有处于转股期的可转换债券
- (4) 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况
- (5) 截至 2009 年 6 月 30 日, 其他资产构成:

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	3,817,775.67
2	应收证券清算款	594,000.00
3	应收股利	602,640.00
4	应收利息	5,019,198.87
5	应收申购款	179,257.63
6	其他应收款	-
7	其他	-
	合计	12,761,229.91

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) 东吴嘉禾优势精选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
2005.2.1-2005.12.31	-7.47%	0.90%	1.25%	0.89%	-8.72%	0.01%
2006.1.1-2006.12.31	128.15%	1.29%	81.40%	0.92%	46.75%	0.37%
2007.1.1-2007.12.31	99.33%	1.93%	106.00%	1.51%	-6.67%	0.42%
2008.1.1-2008.12.31	-46.85%	1.94%	-38.91%	1.96%	-7.94%	-0.02%
2009.1.1-2009.6.30	30.37%	1.17%	49.42%	1.29%	-19.05%	-0.12%
2005.2.1-2009.6.30	191.62%	1.57%	171.59%	1.41%	20.03%	0.16%

注:统计截至 2009 年 6 月 30 日,比较基准=65%*(60%*上证 180+40%*深圳 100)+35%*中信标普全债指数。

(2) 东吴嘉禾优势精选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
(2005 年 2 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日)



注：东吴嘉禾基金从 2005 年 2 月 2 日起正式运作。

十三、费用概览

（一）基金运作相关费用

1、管理费；

基金管理费以基金资产净值的 1.5% 年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。

2、托管费；

基金托管费按基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

3、基金合同生效后的信息披露费用；

4、基金合同生效后的会计师费和律师费；

5、基金份额持有人大会费用。

6、基金的证券交易费用；

7、银行手续费、服务费；

8、基金分红手续费。

9、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

上述第 3 项至第 9 项费用由本基金管理人向基金托管人发出划款指令后，基金托管人按费用实际支出金额从基金财产中支付，列入当期基金费用。

（二）基金销售相关费用

1、申购费用：

申购金额(M)

申购费率

M<100 万	1.5%
100 万≤M<500 万	1.2%
500 万≤M<1000 万	0.8%
M≥1000 万	1000 元/笔

本基金的申购费用由申购人承担,用于市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。

2、赎回费用:

持有年限 (N)	赎回费率
N<1 年	0.5%
1 年≤N<2 年	0.25%
N≥2 年	0

3、基金管理人可以根据情况调低申购费率和赎回费率,调低申购费率、赎回费率不须召开份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登公告。

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,对本基金原招募说明书(《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金更新招募说明书》)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“所载内容截止日期”为 2009 年 8 月 1 日及“有关财务数据和净值表现截止日期”为 2009 年 6 月 30 日。
2. 在“三、基金管理人”中,对基金管理人简要情况进行了介绍,并对主要人员情况等内容进行了更新。
3. 在“四、基金托管人”中,对基金托管人的基金托管业务经营情况进行了更新。
4. 在“五、相关服务机构”,更新并增加了部分代销机构。
5. 在“七、与其他与基金管理人管理的其他基金转换”增加了基金转换业务的相关内容。
6. 在“八、基金的投资”中,更新了基金投资组合报告的内容。
7. 在“九、基金的业绩”中,更新了相关内容。
8. 在“二十一、其他披露事项”中,增加相关公告内容:

- (1) 2009 年 2 月 6 日在中国证券报、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增加深圳平安银行为代销机构并开通定期定额业务的公告》；
- (2) 2009 年 2 月 18 日在中国证券报、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宁波银行股份有限公司推出定期定额投资业务的公告》；
- (3) 2009 年 2 月 24 日在中国证券报、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参加中国工商银行股份有限公司基智定投营销活动的公告》
- (4) 2009 年 2 月 25 日在中国证券报、上海证券报、公司网站等上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在交通银行网上银行基金申购费率优惠调整的公告》；
- (5) 2009 年 2 月 26 日在中国证券报、上海证券报、公司网站等上公告了《东吴基金管理有限公司关于开通旗下基金的基金转换业务的公告》；
- (6) 2009 年 2 月 27 日在中国证券报、上海证券报、公司网站等上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在华夏银行股份有限公司推出定期定额申购费率优惠的公告》
- (7) 2009 年 3 月 5 日在中国证券报、上海证券报、公司网站等上公告了《东吴基金管理有限公司关于增加东海证券有限责任公司为代销机构的公告》；
- (8) 2009 年 3 月 12 日在中国证券报、上海证券报、公司网站等上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金更新招募说明书摘要》；
- (9) 2009 年 3 月 24 日在中国证券报、上海证券报、公司网站等上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加中国建银投资证券有限责任公司为代销机构的公告》；
- (10) 2009 年 3 月 31 日在中国证券报、上海证券报、公司网站等上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在中国工商银行网上银行申购费率优惠的公告》；
- (11) 2009 年 4 月 2 日在中国证券报、上海证券报、公司网站等上公告了《东吴嘉禾优势精选开放式混合型证券投资基金 2008 年年度报告》；
- (12) 2009 年 4 月 9 日在中国证券报、上海证券报、公司网站等上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在中国建设银行股份有限公司实行电话银行基金申购费率优惠的公告》；
- (13) 2009 年 4 月 20 日在中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金 2009 年第 1 季度报告》；
- (14) 2009 年 4 月 20 日在中国证券报、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增加爱建证券有限责任公司为代销机构的公告》；
- (15) 2009 年 4 月 27 日在中国证券报、上海证券报、公司网站等上公告了《东吴基金管理有限公司关于赎回旗下东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金、东吴行业轮动股票型证券投资基金份额的公告》；
- (16) 2009 年 5 月 6 日在中国证券报、上海证券报、公司网站等上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金在联合证券有限责任公司推出定期定额申购费率优惠活动的公告》。
- (17) 2009 年 6 月 16 日在中国证券报、上海证券报、公司网站等上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金增加平安证券有限责任公司为代销机构的公告》；
- (18) 2009 年 6 月 19 日在中国证券报、上海证券报、公司网站等上公告了《东吴基金管理

有限公司关于旗下基金增加华宝证券经纪有限责任公司为代销机构并开通定期定额业务的公告》；

（19）2009 年 7 月 21 日在中国证券报、上海证券报、公司网站等媒体上公告了《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金 2009 年第 2 季度报告》；

十五、签署日期

本基金更新招募说明书于 2009 年 8 月 2 日签署。

东吴基金管理有限公司

2009 年 8 月 2 日