

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。

投资有风险，投资者投资于本基金时应认真阅读本《招募说明书》。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2014 年 8 月 1 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2014 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

- 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：吴靖

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	4900	49%
上海兰生（集团）有限公司	3000	30%
江阴澄星实业集团有限公司	2100	21%
合 计	10,000	100%

15. 简要情况介绍：

东吴基金管理有限公司设立投资管理部、固定收益部、专户业务事业部、量化投资部、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、理财中心、总经理办公室（下设三个二级部门，分别为综合管理部、战略规划部与行政事务部）、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 22 个职能部门。公司已管理的第一只产品东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金，于 2005 年 2 月 1 日基金合同生效，托管行为中国工商银行股份有限公司。公司已管理的第二只产品东吴价值成长双动力股票型证券投资基金，于 2006 年 12 月 15 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第三只产品东吴行业轮动股票型证券投资基金，于 2008 年 4 月 23 日基金合同生效，托管行为华夏银行股份有限公司。公司已管理的第四只产品东吴优信稳健债券型证券投资基金，于 2008 年 11 月 5 日基金合同生效，托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第五只产品东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金，于 2009 年 5 月 6 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第六只产品东吴新经济股票型证券投资基金，于 2009 年 12 月 30 日基金合同生效，托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第七只产品东吴货币市场证券投资基金，于 2010 年 5 月 11 日基金合

同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第八只产品东吴新创业股票型证券投资基金，于 2010 年 6 月 29 日基金合同生效，托管行为中国工商银行股份有限公司。公司已管理的第九只产品东吴中证新兴产业指数证券投资基金，于 2011 年 2 月 1 日基金合同生效，托管行为中国农业银行股份有限公司。公司已管理的第十只产品东吴增利债券型证券投资基金，于 2011 年 7 月 27 日基金合同生效，托管行为中信银行股份有限公司。公司已管理的第十一只产品东吴新产业精选股票型证券投资基金，于 2011 年 9 月 28 日基金合同生效，托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第十二只产品东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF），于 2012 年 3 月 9 日基金合同生效，托管行为中国建设银行股份有限公司。公司已管理的第十三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。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。

（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。

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、上海兰生（集团）有限公司总裁助理、投资管理部总经理。现任上海兰生（集团）有限公司顾问。

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。

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

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

戴继雄先生，董事，硕士，历任上海复星高科技（集团）有限公司财务、审计副总监、上海兰生（集团）有限公司财务副总监、财务金融部总经理。现任上海五金矿产发展有限公司副总经理。

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。

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

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

2、监事会成员

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

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

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

3、高管人员

吴永敏先生，董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）

任少华先生，总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

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

程涛先生，硕士，英国雷丁大学毕业。曾任联合证券有限责任公司投资银行部高级经理，泰信基金管理有限公司研究员、基金经理助理，农银汇理基金管理有限公司基金经理、投资部总经理；2013年3月加入东吴基金管理有限公司，现任公司总经理助理兼首席投资官、专户业务事业部总经理，其中自2013年8月1日起担任东吴嘉禾优势精选混合型证券投资基金基金经理、自2013年8月1日起担任东吴内需增长混合型证券投资基金基金经理、自2013年8月13日起担任东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金经理、自2014年3月19日起担任东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

王立立，硕士，复旦大学世界经济专业。2010年7月至2010年12月就职于中信建投证券有限责任公司投资银行部任经理，2011年1月至2012年7月就职于上海汇利资产管理公司研究部任研究员，自2012年7月起加入东吴基金管理有限公司，曾任研究策划部行业研究员、基金经理助理，自2013年12月24日起担任东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金基金经理、自2014年6月14日起担任东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

历任基金经理

向朝勇，2005年02月01日至2006年10月10日

庞良永，2006年10月10日至2008年05月26日

魏立波，2008年01月08日至2010年01月06日

唐祝益，2009年12月24日至2012年10月27日

邹国英，2012年10月27日至2014年6月14日

5.投资决策委员会成员

任少华 公司总经理；

程 涛 公司总经理助理兼首席投资官、专户业务事业部总经理；

黎 瑛 公司研究总监兼研究策划部总经理；

凌 鹏 公司研究副总监；

杨庆定 固定收益部总经理；

刘元海 投资管理部副总经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

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

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币 349,018,545,827 元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

（二）主要人员情况

截至 2013 年 12 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 160 余人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、

企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2013 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 314 只，其中封闭式 3 只，开放式 311 只。自 2003 年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 40 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）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：任少华

联系人：吴靖

直销电话：（021）50509880

传真：（021）50509884

客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、（021）50509666

网站：www.scfund.com.cn

（2）网上交易

个人投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

网上交易网址：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) 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：查樱

传真：(010) 66105662

客服电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

(4) 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

(5) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：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

(6) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号（100005）

法定代表人：吴建

联系人：李慧

电话：（010）85238670

传真：（010）85238680

客户服务电话：95577

公司网址：www.hxb.com.cn

(7) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

联系人：邓炯鹏

电话：（0755）83198888

传真：（0755）83195049

客服电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

(8) 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

(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.nbcb.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
联系人：陈春林
传真：010-66415194
客服电话：95580
公司网址：www.psbc.com

(11) 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

(12) 温州银行股份有限公司

注册地址：温州市车站大道华海广场 1 号楼
办公地址：温州市车站大道 196 号
法定代表人：邢增福
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

(13) 烟台银行股份有限公司

注册地址：烟台市芝罘区海港路 25 号

办公地址：烟台市芝罘区海港路 25 号

法定代表人：叶文君

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、

（14）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

（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

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

（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：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

(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

联系人: 邓寒冰

电话: 021-54033888

传真: 021-54038844

客服电话: 021-962505

公司网址: www.sywg.com.cn

(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

(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

(20) 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

（21）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

（22）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

（23）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

（24）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

（25） 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：吴倩

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客户服务热线：400-8888-666

（26） 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.cscoc.com.cn

（27） 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

（28） 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

（29）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

（30）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

（31）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

(32) 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

(33) 中信证券（山东）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

(34) 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：400888788、10108998

公司网址：www.ebscn.com

(35) 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

(36) 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

(37) 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

(38) 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

(39) 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

（40）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

（41）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

（42）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

（43）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

（44）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

（45）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

（46）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

（47）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

（48）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

（49）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

（50）宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

电话：010-88085858

传真：010-88085219

客服电话：400-800-0562

公司网址：www.hysec.com

(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) 广州证券有限责任公司

注册地址：广州市越秀区先烈中路69号东山广场主楼17楼

办公地址：广州市越秀区先烈中路69号东山广场主楼17楼

法定代表人：吴志明

联系人：林洁茹

电话：020-87322668

传真：020-87325036

客服电话：020-961303

公司网址：www.gzs.com.cn

（55） 厦门证券有限公司

注册地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

办公地址：厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼

法定代表人：傅毅辉

联系人：卢金文

电话：0592-5161642

传真：0592-5161140

客服热线：0592-5163588

公司网址：www.xmzq.com.cn

（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） 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

（58） 天源证券经纪有限公司

注册地址：青海省西宁市长江路53号汇通大厦六楼

办公地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦18楼

法定代表人：林小明

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

（59） 财富里昂证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号 环球金融中心 9 楼

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

（60） 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

客户服务电话：0571-96598

（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

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：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：任少华

联系人：吴靖

电话：021-50509888

传真：021-50509884

客户服务电话：4008210588

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

注册地址：南京市正洪街18号东宇大厦8楼

办公地址：南京市正洪街18号东宇大厦8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： $65\% \times (60\% \times \text{上证 180 指数} + 40\% \times \text{深证 100 指数}) + 35\% \times \text{中信标普全债指数}$ 。

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 2014 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。

1、截至 2014 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	权益投资	1,845,184,288.17	81.39
	其中：股票	1,845,184,288.17	81.39
2	固定收益投资	50,055,000.00	2.21
	其中：债券	50,055,000.00	2.21
	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	99,200,902.80	4.38
	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	242,754,737.43	10.71
7	其他资产	29,988,168.96	1.32
8	合计	2,267,183,097.36	100.00

2、截至 2014 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	-	-
B	采矿业	67,290,112.11	2.99
C	制造业	1,381,121,591.85	61.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	203,459,423.00	9.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	135,352,703.66	6.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,715,769.15	2.56
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	244,688.40	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,845,184,288.17	81.92

3、截至 2014 年 6 月 30 日按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细：

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	600175	美都控股	35,378,540	203,426,605.00	9.03
2	600261	阳光照明	14,462,995	142,894,390.60	6.34
3	300309	吉艾科技	6,965,754	140,220,628.02	6.23
4	002306	湘鄂情	23,097,731	135,352,703.66	6.01
5	300303	聚飞光电	7,177,603	131,996,119.17	5.86
6	002048	宁波华翔	8,802,648	131,159,455.20	5.82
7	600703	三安光电	4,982,364	116,736,788.52	5.18
8	300306	远方光电	3,889,146	110,490,637.86	4.91
9	600352	浙江龙盛	5,759,971	93,023,531.65	4.13
10	300337	银邦股份	6,714,684	87,760,919.88	3.90

4、截至2014年6月30日，按债券品种分类的债券投资组合：

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,055,000.00	2.22
	其中：政策性金融债	50,055,000.00	2.22
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	50,055,000.00	2.22

5、截至 2014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	130243	13 国开 43	500,000	50,055,000.00	2.22

6、截至 2014 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、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、截至 2014 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。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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

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内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 截至 2014 年 6 月 30 日，其他资产构成：

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,205,675.43
2	应收证券清算款	27,141,737.41
3	应收股利	-
4	应收利息	1,633,329.29
5	应收申购款	7,426.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,988,168.96

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券

(5) 报告期末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	002306	湘鄂情	135,352,703.66	6.01	重大事项停牌

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

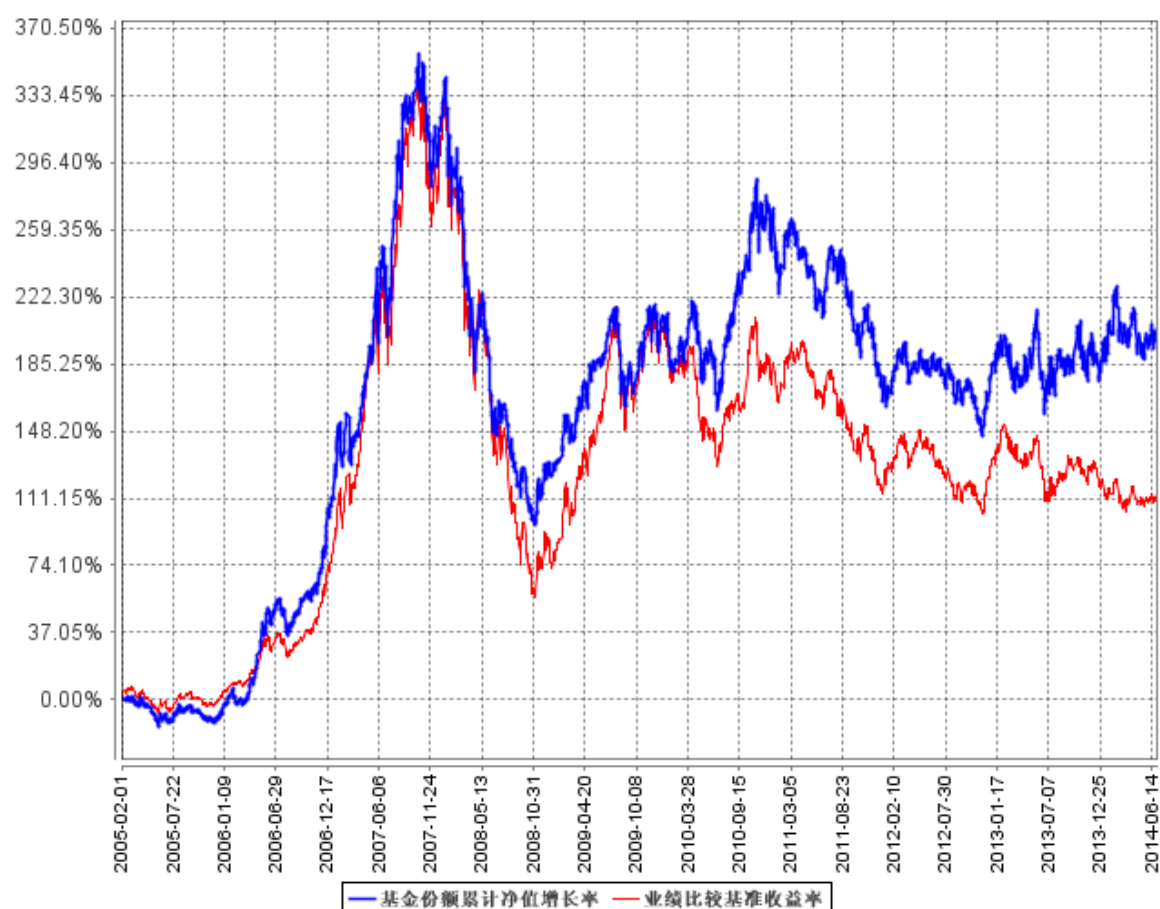
(1) 东吴嘉禾优势精选基金历史时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

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
2005.02.01-2005.12.31	-7.47%	0.90%	1.25%	0.89%	-8.72%	0.01%
2006.01.01-2006.12.31	128.15%	1.29%	81.40%	0.92%	46.75%	0.37%
2007.01.01-2007.12.31	99.33%	1.93%	106.00%	1.51%	-6.67%	0.42%
2008.01.01-2008.12.31	-46.85%	1.94%	-38.91%	1.96%	-7.94%	-0.02%
2009.01.01-2009.12.31	39.00%	1.34%	65.79%	1.35%	-26.79%	-0.01%
2010.01.01-2010.12.31	17.88%	1.45%	-6.41%	1.05%	24.29%	0.40%
2011.01.01-2011.12.31	-23.99%	1.18%	-15.58%	0.87%	-8.41%	0.31%
2012.01.01-2012.12.31	2.42%	1.07%	6.48%	0.86%	-4.06%	0.21%
2013.01.01-2013.12.31	0.70%	1.67%	3.85%	0.92%	4.55%	0.75%
2014.01.01-2014.06.30	6.19%	1.40%	-2.79%	0.69%	8.98%	0.71%
2005.02.01-2014.06.30	205.15%	1.47%	112.57%	1.19%	92.58%	0.28%

注：统计截至2014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(2005年2月1日至2014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：东吴嘉禾基金从2005年2月1日起正式运作。

十三、基金的转换

（一）基金转换业务的适用范围

截至 2014 年 8 月 1 日，本基金已开通与本基金管理人旗下基金：东吴价值成长双动力股票型证券投资基金（基金代码：580002）、东吴行业轮动股票型证券投资基金（基金代码：580003）、东吴优信稳健债券型证券投资基金 A 类（基金代码：582001）、东吴优信稳健债券型证券投资基金 C 类（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）、东吴新经济股票型证券投资基金（基金代码：580006）、东吴创新创业股票型证券投资基金（基金代码：580007）、东吴货币市场证券投资基金 A 类（基金代码：583001）、东吴货币市场证券投资基金 B 类（基金代码：583101）、东吴中证新兴产业指数证券投资基金（基金代码：585001）、东吴保本混合型证券投资基金（基金代码：582003）、东吴新产业精选股票型证券投资基金（基金代码：580008）、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）、东吴内需增长混合型证券投资基金（基金代码：580009）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。

（二）适用销售机构

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：

中信银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行有限责任公司、平安银行股份有限公司、温州银行股份有限公司、烟台银行股份有限公司、东吴证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、东方证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中航证券有限公司、财富证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、恒泰证券股份有限公司、南京证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、华宝证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、厦门证券有限公司、中信证券股份有限公司、天源证券经纪有限公司、财富里昂证券有限责任公司、中信证券（浙

江) 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。

十四、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》、《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,更新了相关内容。
- 2、在“二、释义”中,更新了相关内容。
- 3、在“三、基金管理人”中,更新了相关内容。
- 4、在“四、基金托管人”中,更新了相关内容。
- 5、在“五、相关服务机构”,更新了相关内容。
- 6、在“九、与基金管理人管理的其他基金转换”,更新了相关内容。
- 7、在“十、基金的投资”中,更新了相关内容。
- 8、在“十一、基金的业绩”中,更新了相关内容。
- 9、在“二十三、其他应披露事项”中,更新了相关内容:

(1) 2014年2月7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证券投资基金估值方法变更的公告》;

(2) 2014年2月26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证券投资基金估值方法变更的公告》;

(3) 2014年2月27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证券投资基金估值方法变更的公告》;

(4) 2014年3月12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证券投资基金估值方法变更的公告》;

(5) 2014年3月12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海通证券网上交易系统推出定期定额申购费率优惠的公告》；

(6) 2014年3月17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光大证券股份有限公司手机客户端申购场外开放式基金费率优惠活动的公告》；

(7) 2014年3月17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更新招募说明书摘要（2014年1号）》；

(8) 2014年3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证券投资基金估值方法变更的公告》；

(9) 2014年3月29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2013年年度报告摘要》；

(10) 2014年4月1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证券投资基金估值方法变更的公告》；

(11) 2014年4月1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》；

(12) 2014年4月4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新增万联证券有限责任公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告》；

(13) 2014年4月4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万联证券有限责任公司网上交易系统申购费率优惠的公告》；

(14) 2014年4月10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证券投资基金估值方法变更的公告》；

(15) 2014年4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2014年第一季度报告》;

(16) 2014年6月14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基金经理变更公告》;

(17) 2014年7月1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》;

(18) 2014年7月1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证券投资基金估值方法变更的公告》;

(19) 2014年7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《东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金2014年第二季度报告》;

十六、签署日期

本基金更新招募说明书于 2014 年 9 月 13 日签署。

东吴基金管理有限公司

二零一四年九月十三日