# 东吴中证 500 指数增强型发起式证券投资基金
# 基金份额发售公告

基金管理人：东吴基金管理有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

# 目录

**重要提示** ..... **2**
**一、本基金募集基本情况** ..... **8**
**二、募集方式及相关规定** ..... **14**
**三、个人投资者的开户与认购程序** ..... **15**
**四、机构投资者的开户与认购程序** ..... **18**
**五、清算与交割** ..... **21**
**六、退款** ..... **22**
**七、基金的验资与基金合同的生效** ..... **23**
**八、本次募集有关当事人和中介机构** ..... **24**

# 重要提示

1、东吴中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已获中国证券监督管理委员会证监许可【2026】2474 号文准予募集注册。中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）对本基金募集的注册并不代表其对本基金的风险和收益作出实质性判断、推荐或者保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

2、本基金是契约型开放式、股票型证券投资基金。

3、本基金的管理人和注册登记机构为东吴基金管理有限公司（以下简称“本公司”），基金托管人为江苏银行股份有限公司（以下简称“江苏银行”）。

4、本基金自 2026 年 11 月 16 日起至 2026 年 11 月 27 日止公开发售。在募集期内，本基金通过基金管理人的直销柜台及指定代销机构的销售网点或电子交易平台公开发售。各销售机构的业务办理网点、办理日期和时间等事项参照各销售机构的具体规定。

5、本基金募集对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、发起资金提供方、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

个人投资者指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人。机构投资者指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织。合格境外投资者指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者。

6、投资者欲认购本基金，需开立本公司基金账户。除法律法规另有规定，一个投资者只能开设和使用一个基金账户。不得非法利用他人账户或资金进行认购，也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。

7、投资者首次认购本基金最低金额为人民币 1.00 元（含认购费，如有，A 类基金份额与 C 类基金份额分别计算，下同），追加认购的单笔最低金额为人民币 1.00 元（含认购费，如有）。各销售机构对本基金最低认购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构

的业务规定为准。

8、基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的任何损失由投资者自行承担。

9、本基金为发起式基金，本基金的最低募集份额总额为 1000 万份，基金募集金额不少于 1000 万元人民币。发起资金提供方运用发起资金认购本基金的金额不少于 1000 万元，且认购的基金份额持有期限自基金合同生效之日起不少于 3 年，期间份额不能赎回。法律法规和监管机构另有规定的除外。

10、本公告于 2026 年 11 月 10 日在《上海证券报》上刊登，其仅对本基金基金份额发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请详细阅读刊登在本公司网站（www.scfund.com.cn）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）上的基金合同、托管协议、招募说明书和基金产品资料概要。投资者亦可通过本公司网站下载基金申请表格，了解基金募集相关事宜。

11、在募集期间，各代销机构可能增加部分基金销售网点，具体网点名单及开户认购事项详见各代销机构有关公告，或拨打各代销机构的客户服务电话进行咨询，具体规定以各代销机构的说明为准。本公司在募集期间内还可能增加新的代销机构，投资人可留意相关公告信息或拨打本公司客户服务电话进行咨询。

12、投资者可拨打本公司客户服务电话 400-821-0588 及销售机构客户服务电话咨询购买事宜。各销售基金的销售网点、业务办理日期和具体时间等事项的详细情况参照各销售机构在其销售区域当地的公告。

13、本公司可根据募集期间的具体情况对募集事宜做适当调整。若提前结束募集，本公司将另行公告。

14、风险提示：

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管

理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。

本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为指数增强型基金，主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金为股票指数增强型基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险。本基金采用指数增强投资策略，面临着特有风险，包括但不限于增强策略失效的风险。详见本招募说明书“风险揭示”部分。

本基金投资于证券、期货市场，基金净值会因为证券、期货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：因政策、经济、利率等环境因素对证券价格产生影响而形成的市场风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，合规性风险，本基金的特有风险，本基金法律文件中涉及基金风险收益特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险，其他风险等等。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于境内市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临投资存托凭证的特殊风险。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于存托凭证或选择不将基金资产投资于存托凭证，基金资产并非必然参与存托凭证投资。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。

基金资产投资港股通标的股票时，可能使本基金面临港股通机制下因投资环境、投

资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股通标的股票不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

本基金可投资于股指期货和国债期货，股指期货和国债期货作为一种金融衍生品，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资股指期货所面临的风险主要是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险和操作风险。投资国债期货所面临的风险主要是市场风险、基差风险、流动性风险。

本基金可根据投资策略需要或市场环境变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。基金资产投资科创板股票会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，具体详见本招募说明书中“基金的风险揭示”章节。

本基金投资资产支持证券的特定风险。本基金可投资于资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险，基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，请基金份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的基金净值波动在内的各项风险。

本基金参与债券回购的风险。本基金可参与债券回购，债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对基金组合收益进行放大的同时，也对基金组合的波动性（标准差）进行了放大，即基金组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

本基金可参与融资及转融通证券出借业务。融资及转融通证券出借业务的风险包括但不限于流动性风险、信用风险、市场风险等，这些风险可能会给基金净值带来一定的

负面影响和损失。其中，转融通证券出借业务的流动性风险是指基金面临大额赎回时可能因证券出借原因无法及时变现支付赎回款项的风险；信用风险是指证券出借对手方无法及时归还证券，无法支付相应权益补偿及借券费用的风险；市场风险是指证券出借期间无法正常处置该证券的风险。基金管理人将遵守审慎经营原则，制定科学合理的投资策略和风险管理制度，有效防范和控制风险。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书“侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

本基金单一投资者（基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员作为发起资金提供方除外）持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

《基金合同》生效之日起三年后的对应日（若无对应日则顺延至下一日），若基金资产净值低于 2 亿元，本基金应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止，无需召开基金份额持有人大会审议，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时有效的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。基金份额持有人面临基金合同可能终止的不确定性风险。

《基金合同》生效满三年后基金继续存续的，连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人在履行适当程序后终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。基金份额持有人可能面临基金合同提前终止的不确定性风险。

对于投资者通过直销机构认购、申购的 C 类基金份额计提的销售服务费，或者通过其他销售机构认购、申购且持续持有期限超过一年（即 365 天，下同）的 C 类基金份额继续计提的销售服务费，都将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者，投资者实际收到的赎回款或清算款的金额可能与按披露的基金份额净值计算的结果存在差异。投资者的实际赎回金额和清算资金以登记机构确认数据为准。

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》《基金合同》、基金产品资料概要等信息披露文件。本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为指数增强型基金，主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。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基金《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，并自行承担投资风险。

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导致的投资风险，由投资者自行承担。

15、本基金标的指数为中证 500 指数。该指数以 2004 年 12 月 31 日为基日，以 1000 点为基点。指数编制方法如下：

（1）样本空间

同沪深 300 指数的样本空间。

（2）选样方法

1）在样本空间中剔除沪深 300 指数样本以及过去一年日均总市值排名前 300 的证券；

2）对样本空间内剩余证券按照过去一年日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20%的证券；

3）将剩余证券按照过去一年日均总市值由高到低进行排名，选取排名前 500 的证券作为指数样本。

（3）指数计算

指数计算公式为：报告期指数 =报告期样本的调整市值/除数×1000

其中，调整市值＝Σ(证券价格×调整股本数)。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司官方网站，网址：www.csindex.com.cn。

16、基金管理人拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

# 一、本基金募集基本情况

**（一） 基金名称**

东吴中证500指数增强型发起式证券投资基金

A类基金代码：029353

C类基金代码：029354

**（二） 基金类别**

股票型证券投资基金

**（三） 基金存续期限**

不定期

**（四） 基金运作方式**

契约型开放式

**（五） 基金份额发售面值**

本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。

**（六） 募集对象**

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、发起资金提供方、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

**（七） 基金的最低募集份额总额及金额**

本基金为发起式基金，本基金的最低募集份额总额为 1000 万份，基金募集金额不少于 1000 万元人民币。

**（八） 基金份额的类别**

本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用（通过直销机构认购/申购的除外），但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额。在投资者认购/申购时不收取前端认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金

份额（其中，对于投资者通过直销机构认购/申购的 C 类基金份额，计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者；对于投资者通过其他销售机构认购/申购的 C 类基金份额，持续持有期限超过一年继续计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者）。

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：

计算日某类基金份额净值＝计算日该类基金份额的基金资产净值/计算日发售在外的该类别基金份额总数。

在不违反法律法规规定且对已有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在履行适当程序后可以增加、减少或调整基金份额类别设置、调整现有基金份额类别的申购费率、调低销售服务费率、变更收费方式、停止现有基金份额类别的销售、调整基金份额分类办法及规则等，调整实施前基金管理人依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，不需要召开基金份额持有人大会。

**（九） 销售机构与销售地点**

**1、直销机构：**

东吴基金管理有限公司直销中心

地址：上海市浦东新区银城路117号瑞明大厦9F

邮政编码：200120

电话：021-50509880

传真：021-50509884

联系人：谢玉婷

公司网址：www.scfund.com.cn

本公司已于 2025 年 12 月 25 日关闭直销网上交易平台，直销柜台仅发售本基金 A 类基金份额，C 类基金份额暂不通过直销柜台发售，C 类基金份额后续若在直销柜台上线销售，届时将在基金管理人网站另行公示。

发售期间，客户可以通过本公司客户服务中心电话进行募集相关事宜的问询、开放式基金的投资咨询及投诉等。

**2、代销机构：**

本基金其他销售机构信息详见基金管理人网站公示，敬请投资者留意。基金管理人可根据有关法律法规的要求，增减或变更基金销售机构，并在基金管理人网站公示基金销售机构名录。投资者在各销售机构办理本基金相关业务时，请遵循各销售机构业务规则与操作流程。

**（十） 募集时间安排与基金合同生效**

本基金的募集期自本基金发售之日起不超过 3 个月。

本基金的发售时间为 2026 年 11 月 16 日起至 2026 年 11 月 27 日。在上述期间，本基金面向符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、发起资金提供方、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人同时发售。基金管理人可以根据本基金发售的情况提前终止或延迟发售时间，但最长不得超过 3 个月的募集期。如遇突发事件，以上募集期的安排可以适当调整。

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在发起资金提供方使用发起资金认购本基金的金额不少于 1000 万元人民币、且发起资金提供方承诺其认购的基金份额持有期限自基金合同生效之日起不少于 3 年的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，验资报告需对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明。基金管理人自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2、在基金募集期限届满后 30 日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；

3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

**（十一） 认购原则**

1、本基金认购采用“金额认购，份额确认”的方式；

2、投资者在认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款；

3、投资者在基金募集期内可以多次认购基金份额，通过其他销售机构认购 A 类基金份额的认购费按每笔 A 类基金份额认购申请单独计算，认购申请一经受理不得撤销。

4、募集期内，单个投资人的累计认购金额没有限制；

5、如本基金单个投资人（基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员作为发起资金提供方除外）累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的 50%，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的，基金管理人可以拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准；

6、基金销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的任何损失由投资者自行承担。

## （十二） 发起资金的认购

发起资金提供方运用发起资金认购本基金的金额不少于 1000 万元，且认购的基金份额持有期限自基金合同生效之日起不少于 3 年，期间份额不能赎回。其中发起资金来源于基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员的资金。认购本基金基金份额的高级管理人员或基金经理在上述期限内离职的，其持有期限承诺不受影响。法律法规或中国证监会另有规定的除外。

本基金发起资金的认购情况见基金管理人届时发布的公告。

## （十三） 基金认购费率

1、投资者通过直销机构认购本基金 A 类基金份额，不收取认购费用。投资者通过其他销售机构认购本基金 A 类基金份额，收取认购费用，C 类基金份额不收取认购费用。

投资者如果有多笔通过其他销售机构认购的 A 类基金份额，适用费率按单笔分别计算。

投资者通过其他销售机构认购本基金 A 类基金份额认购费率见下表：

| 认购金额 M（含认购费，元） | A 类基金份额认购费率 |
| --- | --- |
| M<500 万 | 0.30% |
| 500 万≤M | 固定费用 1,000 元/笔 |

通过其他销售机构认购本基金 A 类基金份额的认购费用应在投资者认购 A 类基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等基金募集期间发生的各项费用。

2、基金认购份额的计算

（1）本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元。

（2）认购份额的计算方法如下：

1）认购本基金 A 类基金份额的计算公式

a、若投资者通过直销机构认购 A 类基金份额：

认购份额＝（认购金额＋认购期间利息）/ 基金份额发售面值

b、若投资者通过其他销售机构认购 A 类基金份额：

投资者的认购金额包括认购费用和净认购金额。

①认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法如下：

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=（净认购金额＋认购期间利息）/基金份额发售面值

②认购费用适用固定金额时，认购份额的计算方法如下：

认购费用＝固定金额

净认购金额＝认购金额-认购费用

认购份额＝（净认购金额＋认购期间利息）/基金份额发售面值

例一：某投资者通过直销机构投资 10,000.00 元认购本基金 A 类基金份额，无认购费用，假设这 10,000.00 元在募集期间产生的利息为 10.00 元，则其可得到的 A 类基金份额计算如下：

认购份额＝(10,000.00+10.00)/1.00＝10,010.00 份

即：该投资者通过直销机构投资 10,000.00 元认购本基金 A 类基金份额，无认购费用，假设这 10,000.00 元在募集期间产生的利息为 10.00 元，则其可得到 10,010.00 份 A 类基金份额。

例二：某投资者通过其他销售机构投资 10,000.00 元认购本基金 A 类基金份额，对应的认购费率为 0.30%，假设这 10,000.00 元在募集期间产生的利息为 10.00 元，则其可得到的 A 类基金份额计算如下：

净认购金额=10,000.00/（1+0.30%）=9970.09 元

认购费用=10,000.00－9,970.09=29.91 元

认购份额=（9,970.09＋10.00）/1.00=9,980.09 份

即：该投资者通过其他销售机构投资 10,000.00 元认购本基金 A 类基金份额，对应的认购费率为 0.30%，假设这 10,000.00 元在募集期间产生的利息为 10.00 元，则其可得到 9,980.09 份 A 类基金份额。

（2）认购本基金 C 类基金份额的计算公式

认购份额=（认购金额＋认购期间利息）/基金份额发售面值

例三：某投资者投资 10,000.00 元认购本基金 C 类基金份额，无认购费用，假设这 10,000.00 元在募集期间产生的利息为 10.00 元，则其可得到的 C 类基金份额计算如下：

认购份额＝(10,000.00+10.00)/1.00＝10,010.00 份

即：该投资者投资 10,000.00 元认购本基金 C 类基金份额，无认购费用，假设这 10,000.00 元在募集期间产生的利息为 10.00 元，则其可得到 10,010.00 份 C 类基金份额。

（3）认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

3、首次募集期间认购资金利息的处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。

# 二、募集方式及相关规定

1、本次基金的募集，在募集期内面向个人投资者、机构投资者、发起资金提供方、合格的境外机构投资者及人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人同时发售。

2、在本公司直销中心可接受投资者单笔认购金额在 10.00 元人民币以上的认购申请，各代销机构可接受投资者单笔认购金额在 1.00 元人民币以上的认购申请。各销售机构对本基金最低认购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

3、募集期投资者可以重复认购本基金，其中机构投资者需在其首次办理开户和认购的销售网点办理重复认购。

4、销售网点（指代销网点或直销中心）对申请的受理并不表示对该申请的成功确认，而仅代表销售网点确实接受了认购申请。申请的成功确认应以基金合同生效后，注册登记人（本基金的登记机构由本公司担任）的确认登记为准。投资者可以在基金合同生效后第二天起到原认购网点查询。

# 三、个人投资者的开户与认购程序

个人投资者可到当地基金代销网点办理基金的开户与认购，代销网点每个基金账户首次单笔最低认购金额为1.00元，追加认购最低金额为1.00元，各销售机构对本基金最低认购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准；个人投资者也可选择到本公司的直销中心进行认购，投资人通过本公司直销渠道办理本基金的投资业务，单笔最低认购金额10.00元，追加认购单笔最低限额为10.00元。

**（一）东吴基金直销中心开户及认购程序**

**1、开户及认购的业务办理时间：**

2026 年 11 月 16 日起至 2026 年 11 月 27 日 9：00～17：00（周六、周日和法定节假日不营业）。

**2、开户及认购程序：**

（1）个人投资者办理开户申请时，应亲赴直销中心，并提供下列资料：

a、填妥的《开放式基金账户申请表》；

b、中华人民共和国公民有效身份证件（身份证、军人证、武警证、护照等，以下简称“有效身份证件”）原件及复印件；

c、指定银行账户的银行卡原件及复印件；

d、填妥的《风险评测问卷及风险评估表》；

e、管理人要求的其他材料。

注：指定银行账户是指：在本直销中心认购基金的个人投资者需指定一家商业银行开立的银行账户作为投资者赎回、分红及无效认（申）购的资金退款等资金结算汇入账户。此账户可为投资者在任一商业银行的存款账户，账户名称必须与客户名称严格一致。

（2）将足额认购资金汇入本公司指定直销资金专户，账户具体信息如下：

**浦发（苏州）：**

户名：东吴基金管理有限公司直销专户

账号：89010078801300008570

开户行：上海浦东发展银行股份有限公司苏州分行

大额支付系统号：310305000013

在办理汇款时，投资者必须注意以下事项：

a、投资者的汇款银行账户必须与基金交易账户所绑定的银行账户信息一致；

b、投资者应在“汇款人”栏中填写其在本公司直销中心开立基金账户时登记的姓名；

c、已经开户的注明交易账号；还没有开户的注明资金用途“购买东吴中证 500 指数增强型发起式证券投资基金”，并确保在提出认购申请当日 17:00 前到账；

d、投资者申请的认购金额不可超过汇款金额；

e、投资者若未按上述规定划付，造成认购无效的，本公司及直销专户的开户银行不承担任何责任。

（3）个人投资者办理认购手续须提供下列资料：

a、填妥并签字的《开放式基金交易申请表》；

b、本人身份证件原件及复印件；

c、加盖银行业务受理章的汇款单据或网上银行电子汇款凭证原件及复印件；

d、加盖银行受理章的银行付款凭证回单联的原件及复印件；

e、如有授权经办人，则还须提供：

① 基金业务授权委托书（授权情况下）；

② 授权经办人身份证原件及复印件。

**3、注意事项**

（1）投资者开立基金账户未确认前，可以办理认购申请。如基金账户开户失败，则认购申请失败，认购资金退回投资者。

（2）投资者不能以现金方式认购。在直销中心开户的个人投资者必须指定一个银行账户作为投资基金的唯一结算账户，今后投资者赎回、分红及无效认/申购等的资金退款等资金结算均只能通过此账户进行。

（3）基金募集期结束，以下将被认定为无效认购：

a、投资者划入资金，但未办理开户手续或开户不成功的；

b、投资者划入资金，但未办理认购申请或认购申请未被确认的；

c、投资者划入的认购资金少于其申请的认购金额的；

d、投资者在提出认购申请当日 17：00 之前资金未到达本公司指定直销专户的；

e、本公司确认的其它无效资金或认购失败资金。

**（二）特别提示**

1、请有意认购本基金的个人投资者尽早向直销中心或代销网点索取开放式基金账户开户及认购申请表。个人投资者也可从本公司的网站 www.scfund.com.cn 下载有关直销业务表格，但必须在办理业务时保证提交的材料与下载文件中的要求的格式一致。

2、直销中心与代销网点的业务申请表不同，个人投资者请勿混用。

3、个人投资者通过代销网点认购本基金，需准备足额的认购资金存入指定的资金结算账户，由代销机构扣划相应款项。

4、认购期结束，以下情况将被视为无效认购，款项将退往投资者指定的资金结算账户：

（1）投资者划入资金，但未办理注册或开户手续或办理不成功的；

（2）投资者划入资金，但未办理认购申请手续或认购申请未被确认的；

（3）投资者划入的认购资金少于其申请的认购金额的，在认购期结束时仍未补足；

（4）投资者在提出认购申请当日 17：00 之前，未将足额资金划到直销专户；

（5）其他导致认购无效的情况。

**（三）各销售银行**

各销售银行开户和认购的相关程序以该银行相关规定为准。

**（四）各销售券商**

各销售券商开户和认购的相关程序以该券商相关规定为准。

**（五）各独立基金销售机构**

各独立基金销售机构开户和认购的相关程序以该机构相关规定为准。

# 四、机构投资者的开户与认购程序

机构投资者可到当地基金代销网点办理基金的开户与认购，代销机构网点首次单笔最低认购金额为1.00元，追加认购最低金额为1.00元，各销售机构对本基金最低认购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。机构投资者也可选择到本公司的直销中心认购，投资人通过本公司直销渠道办理本基金的投资业务，单笔最低认购金额10.00元，追加认购单笔最低限额为10.00元。

**（一）东吴基金直销中心开户与认购程序**

**1、业务办理时间**

2026 年 11 月 16 日起至 2026 年 11 月 27 日 9：00～17：00（周六、周日和法定节假日不营业）。

**2、开户及认购程序**

（1）机构投资者办理开户手续时，须提供下列资料：

a、《开放式基金账户申请表（机构/产品）》（一份，加盖公章、法人章、经办人印鉴）

b、《传真交易协议书》（一式两份，加盖公章）

c、《预留印鉴卡》（一式三份，加盖公章、私章各一枚，如私章非法人代表，需提供法人授权委托书）

d、《授权委托书》（一份，加盖公章、法人章）

e、企业营业执照正本或副本的复印件；事业法人、社会团体或其他组织提供民政部门或主管部门颁发的注册登记证书的复印件；（一份，加盖公章）②

f、组织机构代码证复印件（一份，加盖公章）②

g、税务登记证复印件（一份，加盖公章）②

h、银行账户《结算申请表》或《开户许可证》或银行出具的其他开户证明的复印件，此账户用于日后交易所用。（一份，加盖公章）①

i、法人有效身份证件的正反面复印件（一份，加盖公章）

j、经办人有效身份证件的正反面复印件（一份，加盖公章）

k、《风险评测问卷及风险评估》机构版（一份，加盖公章）

l、《投资者投资知识测试》（一份，加盖公章）

m、金融许可证（一份，加盖公章，如没有可不提供）

n、《直销机构受益人信息收集表》（一份，加盖公章）

o、如以产品开户，提供此产品的备案函以及产品合同的首末页（一份，加盖公章）

p、提供最近 1 年末净资产证明及最近 1 年末金融资产证明（各一份，加盖公章，法人章，经办人印鉴）此条针对于普通投资者③

重要提示：

注①：《结算申请表》、《开户许可证》可询问公司财务部。

注②：营业执照、组织机构代码、税务登记证如已三证合一，只需提供营业执照正本或副本的复印件即可。

注③：专业投资者判定标准：（一）经有关金融监管部门批准设立的金融机构，包括证券公司、期货公司、基金管理公司及其子公司、商业银行、保险公司、信托公司、财务公司等；经行业协会备案或者登记的证券公司子公司、期货公司子公司、私募基金管理人。（二）上述机构面向投资者发行的理财产品，包括但不限于证券公司资产管理产品、基金管理公司及其子公司产品、期货公司资产管理产品、银行理财产品、保险产品、信托产品、经行业协会备案的私募基金。（三）社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）。

其他组织或机构视为普通投资者，请根据实际情况提交最近 1 年末净资产及最近 1 年末金融资产证明；视风险测评结果可认/申购相应的基金产品；如此类投资者想申请成为专业投资者，请提交《普通投资者转化专业投资者告知及确认书》、最近 1 年末净资产不低于 2000 万元的证明、最近 1 年末金融资产不低于 1000 万元的证明。

（2）将足额认购资金汇入本公司指定直销资金专户，具体信息如下：

**浦发（苏州）：**

户名：东吴基金管理有限公司直销专户

账号：89010078801300008570

开户行：上海浦东发展银行股份有限公司苏州分行

大额支付系统号：310305000013

在办理汇款时，投资者必须注意以下事项：

a、投资者应在“汇款人”栏中填写其在本公司直销中心开立基金账户时登记的名称；

b、投资者所填写的汇款用途须注明“购买东吴中证500指数增强型发起式证券投资基金”，并确保在提出认购申请当日17:00点前到账；

c、投资者申请的认购金额不能超过汇款金额；

d、投资者若未按上述规定划付，造成认购无效的，本公司及直销专户的开户银行不承担任何责任。

（3）办理基金认购手续的投资者须提供下列资料：

a、填妥并加盖预留印鉴的《开放式基金交易申请表》；

b、授权经办人的有效身份证件和复印件；

c、加盖银行业务受理章的汇款单据或网上银行电子汇款凭证原件及复印件。

**3、注意事项**

（1）投资者不能以现金方式认购。在直销中心开户的机构投资者必须指定一个银行账户作为投资基金的唯一结算账户，今后投资者赎回、分红及无效认/申购等的资金退款等资金结算均只能通过此账户进行。

（2）基金募集期结束，以下将被认定为无效认购：

a、投资者划入资金，但未办理开户手续或开户不成功的；

b、投资者划入资金，但未办理认购申请或认购申请未被确认的；

c、投资者划来的认购资金少于其申请的认购金额的；

d、在提出认购申请当日17:00之前资金未到指定直销专户的；

e、本公司确认的其它无效资金或认购失败资金。

**（二）特别提示**

1、请有意认购本基金的机构投资者尽早向直销中心或代销网点索取开放式基金账户开户及认购申请表。机构投资者也可从本公司的网站 www.scfund.com.cn 下载有关直销业务表格，但必须在办理业务时保证提交的材料与下载文件中的要求的格式一致。

2、机构投资者通过代销网点认购本基金，需准备足额的认购资金存入指定的资金结算账户，由代销机构扣划相应款项。

3、认购期结束，以下情况将被视为无效认购，款项将退往投资者指定的资金结算账户：

（1）投资者划入资金，但未办理开户手续或开户不成功的；

（2）投资者划入资金，但未办理认购申请手续或认购申请未被确认的；

（3）投资者划入的认购资金少于其申请的认购金额的，在认购期结束时仍未补足的；

（4）其他导致认购无效的情况。

**（三）各销售银行**

各销售银行开户和认购的相关程序以该银行相关规定为准。

**（四）各销售券商**

各销售券商开户和认购的相关程序以该券商相关规定为准。

**（五）各独立基金销售机构**

各独立基金销售机构开户和认购的相关程序以该机构相关规定为准。

# 五、清算与交割

1、基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。认购资金冻结期间的资金利息转换成基金份额归投资人所有。利息的具体金额以本基金的登记机构的计算、确认为准。

2、本基金权益登记由基金登记机构（东吴基金管理有限公司）在募集结束后完成过户登记。

# 六、退款

1、投资者通过代销机构进行认购时产生的无效认购资金的退款时间和方式详见各代销机构业务规则。

2、基金募集期限届满，未达到基金合同生效条件，或募集期内发生使基金合同无法生效的不可抗力，则基金募集失败。如本基金募集失败，需在基金募集期限届满后30日内返还基金投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

# 七、基金的验资与基金合同的生效

（一）验资

本基金自基金份额发售之日起三个月内，在基金募集份额总额不少于 1000 万份，基金募集金额不少于 1000 万元人民币，其中使用发起资金认购本基金的金额不少于 1000 万元人民币、且发起资金提供方承诺其认购的基金份额持有期限自基金合同生效之日起不少于 3 年的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，验资报告需对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明。基金管理人自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

（二）合同生效

基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，基金合同生效；否则基金合同不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对基金合同生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

# 八、本次募集有关当事人和中介机构

**（一）基金管理人**

东吴基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城路117号9楼901、902室

办公地址：上海市浦东新区银城路117号瑞明大厦9F

法定代表人：李素明

成立日期：2004年9月2日

客户服务电话：400-821-0588

传真：021-50509884

联系人：谢玉婷

**（二）基金托管人**

江苏银行股份有限公司

注册地址：中国江苏省南京市中华路 26 号

办公地址：中国江苏省南京市中华路 26 号

法定代表人：袁军

客服电话：95319

公司网址：www.jsbchina.cn

**（三）销售机构**

**1、直销机构：**

东吴基金管理有限公司直销中心

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城路 117 号 9 楼 901、902 室

办公地址：上海市浦东新区银城路 117 号瑞明大厦 9F

法定代表人：李素明

联系人：谢玉婷

直销中心电话：021-50509880

传真：021-50509884

客户服务电话：400-821-0588

网站：www.scfund.com.cn

**2、代销机构：**

本基金其他销售机构信息详见基金管理人网站公示，敬请投资者留意。基金管理人可根据有关法律法规的要求，增减或变更基金销售机构，并在基金管理人网站公示基金销售机构名录。投资者在各销售机构办理本基金相关业务时，请遵循各销售机构业务规则与操作流程。

**（四）登记机构**

名称：东吴基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城路117号9楼901、902室

办公地址：上海市浦东新区银城路117号瑞明大厦9F

法定代表人：李素明

成立日期：2004年9月2日

客户服务电话：400-821-0588

传真：021-50509884

联系人：谢玉婷

**（五）出具法律意见书的律师事务所**

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 18-20 楼

负责人：陈臻

电话：（021）31358666

传真：（021）31358600

联系人：丁媛

经办律师：丁媛、王元婕

**（六）审计基金财产的会计师事务所**

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层

法定代表人：邹俊

经办注册会计师：黄小熠

电话：021 2212 2888

传真：021 6288 1889

东吴基金管理有限公司

二零二六年十一月十日