

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
报告日期:二〇一五年八月二十七日

\$ 1 重要提示及目录

基金管理人的董事、董事会、监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的责任。本基金半年报告已经三分之二以上独立董事签字确认，说明基金托管人对报告期内本基金投资运作是否合规、净值计算、利润分配等方面进行了复核，对本基金的基金资产净值计算、基金收益分配政策等进行了复核，对本基金的基金资产运作是否符合监管规定进行了监督，未发现基金托管人有损 害基金份额持有人利益的行为。

本报告期间摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告所载财务资料未经审计。

本报告期自2015年01月01日起至2015年06月30日止。

\$ 2 基金简介

基金名称	东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF)
场内简称	东吴100
基金代码	169806
交易简称	169806
基金上市方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2012年3月9日
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
报告期末基金资产总额	12,528,469.26
基金合同的存续期	不定期
基金上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012-04-27

2.1 基金基本情况

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，通过定期调整和择时构建股票组合与风险管理，力争超越行业比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金在追求绝对收益的同时，严格控制风险，力求基金资产净值增长率不超过5%，年度跟踪误差不超过7%。

2.2 基金产品说明

本基金主要采用指数化投资的方法运作，跟踪深证100价格指数，按照行业分类和风格构造股票组合及结构构建股票组合，并根据指数成份股及其权重的变动情况适时调整，力求对标的指数进行有效的跟踪。本基金还将适当增加增强策略和行业配置的组合管理与风险管理，力图获得超越行业比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

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

本基金投资组合比例为：股票资产占基金总资产的比例不低于80%，现金类资产(包括货币市场基金)占基金总资产的比例不高于20%。

本基金投资于股票的比例不低于80%，其中投资于深证100成份股的比例不低于80%。

本基金投资于债券的比例不高于20%，其中投资于国债的比例不高于10%。

本基金投资于权证的比例不高于10%，其中投资于深证100成份股的比例不高于10%。

本基金投资于股指期货的比例不高于10%，其中投资于深证100成份股的比例不高于10%。

本基金投资于资产支持证券的比例不高于10%，其中投资于深证100成份股的比例不高于10%。

本基金投资于股票型基金的比例不高于10%，其中投资于深证100成份股的比例不高于10%。

本基金投资于商品基金的比例不高于10%，其中投资于深证100成份股的比例不高于10%。

本基金投资于其他基金的比例不高于10%，其中投资于深证100成份股的比例不高于10%。

本基金投资于境外证券市场的股票的比例不高于10%，其中投资于深证100成份股的比例不高于10%。

本基金投资于境外证券市场的债券的比例不高于10%，其中投资于深证100成份股的比例不高于10%。

本基金投资于境外证券市场的权证的比例不高于10%，其中投资于深证100成份股的比例不高于10%。

本基金投资于境外证券市场的股指期货的比例不高于10%，其中投资于深证100成份股的比例不高于10%。

本基金投资于境外证券市场的资产支持证券的比例不高于10%，其中投资于深证100成份股的比例不高于10%。

本基金投资于境外证券市场的商品基金的比例不高于10%，其中投资于深证100成份股的比例不高于10%。

本基金投资于境外证券市场的其他基金的比例不高于10%，其中投资于深证100成份股的比例不高于10%。

本基金投资于境外证券市场的股票的比例不高于10%，其中投资于深证100成份股的比例不高于10%。

本基金投资于境外证券市场的债券的比例不高于10%，其中投资于深证100成份股的比例不高于10%。

<p