

(上接B145版)

住所:北京市西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:金鼎
办公地址:北京市西城区金融大街27号投资广场2层
联系电话:(010-58598853)
传真:(010-58580077)
联系人:王磊
(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2层
办公地址:北京市西城区金融大街9号金融街中心南楼2层
负责人:陶建雄
电话:(010-66232399
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:南京立信德润会计师事务所
住所:南京市建邺区江东中路106号万达广场商务楼B座(14幢)12幢
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)12幢
法定代表人:余瑞玉
经办注册会计师:陶建雄、魏娜
电话:(025-84711188
传真:(025-84711683

四、基金名称

本基金名称:东吴深证100指数增强型证券投资基金

五、基金的类型

基金的类别:股票型基金。

六、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%,年跟踪误差率不超过7.5%。

七、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其他)、债券、权证以及经中国证监会批准允许本基金投资的其他金融工具,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,本基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产中基金资产的比例为90%-95%,投资于标的指数的成份股、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占基金资产净值的比例,在法律法规允许的范围内,本基金管理人可进行调整。

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,在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上,本基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金主要采用指数复制的方法跟踪深证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的调整。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组合管理与风险控制,力求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%。本基金还将根据宏观经济环境、市场估值、行业轮动等因素,在法律法规允许的范围内,进行适度的资产配置,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价格指数作为跟踪的指数。

本基金在构建基金股票资产时,按照深证100价格指数成份股的投资占权重买入,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基准配置组合,并进行持续调整。在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法买入足够数量的股票时,基金管理人将择机用其他合法方法进行适当的替代。

(2)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的权重的时候,本基金将根据指数公司在股息支付公告中已公布的时间间隔及时调整及其调整的时间间隔,进行相应的调整。

3.对特殊情况的处理
本基金在某类特殊情形下将选择其他股票投资组合以目标指数的成份股加以替换,这些情形包括:a)法律法规的限制;b)标的指数成份股流动性严重不足;c)成份股上市公司存在重大负面陈述等违规行为,或者面临重大的不利诉讼或破产风险等。本基金在遇到上述情形时,将采用替代股票进行替换,以维持跟踪目标指数的目的。在投资业务和风险管理上,用于替换的股票与被替换的股票的市场价格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,用于替换的股票先以目标指数的其他成份股中挑选,如不能挑选出合适的股票,再考虑从非目标指数成份股中挑选。

(4)指数增强策略
本基金增强策略主要包括:成份股量化增强策略和非成份股增强策略。

1)成份股量化增强策略
本基金成份股量化增强策略采用东吴多因子增强模型,主要方法为选取行业、成长、盈利、市场特征四大类因子,建立Alpha多因子模型,大类因子由一系列因子组成,其中价值因子主要是股票票的价格相对估值水平,包括市盈率、市净率、市销率、EV/EBITDA;成长因子主要包括上市公司主营业务收入、现金流、净利润等指标的同比增长和环比增长;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同比增长和环比增长;市场特征因子主要包括股票换手率、交易金额、换手率以及其它低因子。上述因子能够较好的反映市场的诸多波动因素,能够寻找较好的投资机会。

东吴多因子量化增强模型,本基金对深证100价格指数成份股进行综合评价,并根据评价结果,在严格控制跟踪误差的前提下,对跟踪指数成份股进行优化配置,作为指数增强策略中的参考。

2)非成份股增强策略
本基金在成份股的选择,本基金采用“东吴基金企业竞争优势评价模型”,该模型按照根据传统的五种竞争力模型,深入分析上市公司战略管理优势、技术优势、市场优势、资源运营优势、资源及其附加优势,采用定性的方法得到上市公司竞争优势评价结果,并据此对非成份股进行筛选,通过对比基金基金需求的市场分析,制定相应的非成份股投资策略,以期达到增强收益的目的。

本基金可投资于预期将有人指数的个股,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
本基金力争跟踪误差不得超过1%;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%,年跟踪误差率不超过7.5%。

本基金跟踪误差控制为基金风险控制的重要组成部分,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需要,以获取稳定收益。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:宏观经济状况、资金供求状况、基准利率、债券收益率曲线、市场流动等。基金管理人将首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,并通过对基金基金需求的市场分析,制定相应的非政府债券投资策略,合理分配基金资产在债券上的配置比例。

八、基金业绩比较基准

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率(税后)

九、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水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。

十、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”)基金管理人承诺本基金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。

2016年4月21日,上海新梅置业股份有限公司(以下简称“公司”)收到上海证券交易所有关上证公函[2016]0405号《关于对上海新梅置业股份有限公司2015年年度报告的事后审核问询函》(以下简称《问询函》),根据上海证券交易所的相关规定,现将《问询函》的内容公告如下:

依据《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第2号-年度报告的内容与格式》(以下简称《格式准则第2号》)、上海证券交易所行业信息披露指引等规则的要求,经对公司2015年年度报告的事后审核,为便于投资者理解,请公司从生产经营、财务等方面进一步补充披露下述信息。

一、关于房地产经营情况

1.行业发展状况,请补充披露上海房地产行业的发展状况,包括房地产土地购置面积、房地产新开工面积、房地产施工(在建)面积、房地产竣工面积、房地产销售面积以及库存去化周期等信息。

2.存货跌价准备和投资性房地产减值准备,报告期内公司对“江阴泰布斯特”待售房产计提存货跌价准备1981.97万元,对“江阴南布新”“自持商业地产”计提了投资性房地产减值准备7780.70万元,请结合相关项目所处区域的市场环境现状、未来发展趋势、成本费用支出情况以及减值准备发生期间等因素详细分析披露本次计提存货跌价准备和减值准备的具体依据,请年审会计师就相关会计确认发表专项意见。

3.投资性房地产:本期投资性房地产减少6504.81万元,请公司说明相关投资性房地产所涉及的项目以及减少的原因。

二、关于财务问题

4.营业外收入:报告期内公司营业外收入增加了2701.82万元,公司解释主要原因系子公司江阴新梅和上海新兰本期确认无需支付的工程款计入营业外收入所致,请公司说明无需支付的原因,将其确认为营业外收入是否符合相关会计准则的要求,请年审会计师就相关会计确认发表专项意见。

上海新梅置业股份有限公司

关于收到上海证券交易所有关于对公司2015年年度报告的事后审核问询函的公告

本公司董事会及全体董事保证公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

2016年4月21日,上海新梅置业股份有限公司(以下简称“公司”)收到上海证券交易所有关上证公函[2016]0405号《关于对上海新梅置业股份有限公司2015年年度报告的事后审核问询函》(以下简称《问询函》),根据上海证券交易所的相关规定,现将《问询函》的内容公告如下:

依据《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第2号-年度报告的内容与格式》(以下简称《格式准则第2号》)、上海证券交易所行业信息披露指引等规则的要求,经对公司2015年年度报告的事后审核,为便于投资者理解,请公司从生产经营、财务等方面进一步补充披露下述信息。

一、关于房地产经营情况

1.行业发展状况,请补充披露上海房地产行业的发展状况,包括房地产土地购置面积、房地产新开工面积、房地产施工(在建)面积、房地产竣工面积、房地产销售面积以及库存去化周期等信息。

2.存货跌价准备和投资性房地产减值准备,报告期内公司对“江阴泰布斯特”待售房产计提存货跌价准备1981.97万元,对“江阴南布新”“自持商业地产”计提了投资性房地产减值准备7780.70万元,请结合相关项目所处区域的市场环境现状、未来发展趋势、成本费用支出情况以及减值准备发生期间等因素详细分析披露本次计提存货跌价准备和减值准备的具体依据,请年审会计师就相关会计确认发表专项意见。

3.投资性房地产:本期投资性房地产减少6504.81万元,请公司说明相关投资性房地产所涉及的项目以及减少的原因。

二、关于财务问题

4.营业外收入:报告期内公司营业外收入增加了2701.82万元,公司解释主要原因系子公司江阴新梅和上海新兰本期确认无需支付的工程款计入营业外收入所致,请公司说明无需支付的原因,将其确认为营业外收入是否符合相关会计准则的要求,请年审会计师就相关会计确认发表专项意见。

上海新梅置业股份有限公司

关于收到上海证券交易所有关于对公司2015年年度报告的事后审核问询函的公告

本公司董事会及全体董事保证公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

2016年4月21日,上海新梅置业股份有限公司(以下简称“公司”)收到上海证券交易所有关上证公函[2016]0405号《关于对上海新梅置业股份有限公司2015年年度报告的事后审核问询函》(以下简称《问询函》),根据上海证券交易所的相关规定,现将《问询函》的内容公告如下:

依据《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第2号-年度报告的内容与格式》(以下简称《格式准则第2号》)、上海证券交易所行业信息披露指引等规则的要求,经对公司2015年年度报告的事后审核,为便于投资者理解,请公司从生产经营、财务等方面进一步补充披露下述信息。

一、关于房地产经营情况

1.行业发展状况,请补充披露上海房地产行业的发展状况,包括房地产土地购置面积、房地产新开工面积、房地产施工(在建)面积、房地产竣工面积、房地产销售面积以及库存去化周期等信息。

2.存货跌价准备和投资性房地产减值准备,报告期内公司对“江阴泰布斯特”待售房产计提存货跌价准备1981.97万元,对“江阴南布新”“自持商业地产”计提了投资性房地产减值准备7780.70万元,请结合相关项目所处区域的市场环境现状、未来发展趋势、成本费用支出情况以及减值准备发生期间等因素详细分析披露本次计提存货跌价准备和减值准备的具体依据,请年审会计师就相关会计确认发表专项意见。

3.投资性房地产:本期投资性房地产减少6504.81万元,请公司说明相关投资性房地产所涉及的项目以及减少的原因。

二、关于财务问题

4.营业外收入:报告期内公司营业外收入增加了2701.82万元,公司解释主要原因系子公司江阴新梅和上海新兰本期确认无需支付的工程款计入营业外收入所致,请公司说明无需支付的原因,将其确认为营业外收入是否符合相关会计准则的要求,请年审会计师就相关会计确认发表专项意见。

上海新梅置业股份有限公司

关于收到上海证券交易所有关于对公司2015年年度报告的事后审核问询函的公告

本公司董事会及全体董事保证公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

2016年4月21日,上海新梅置业股份有限公司(以下简称“公司”)收到上海证券交易所有关上证公函[2016]0405号《关于对上海新梅置业股份有限公司2015年年度报告的事后审核问询函》(以下简称《问询函》),根据上海证券交易所的相关规定,现将《问询函》的内容公告如下:

依据《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第2号-年度报告的内容与格式》(以下简称《格式准则第2号》)、上海证券交易所行业信息披露指引等规则的要求,经对公司2015年年度报告的事后审核,为便于投资者理解,请公司从生产经营、财务等方面进一步补充披露下述信息。

一、关于房地产经营情况

1.行业发展状况,请补充披露上海房地产行业的发展状况,包括房地产土地购置面积、房地产新开工面积、房地产施工(在建)面积、房地产竣工面积、房地产销售面积以及库存去化周期等信息。

2.存货跌价准备和投资性房地产减值准备,报告期内公司对“江阴泰布斯特”待售房产计提存货跌价准备1981.97万元,对“江阴南布新”“自持商业地产”计提了投资性房地产减值准备7780.70万元,请结合相关项目所处区域的市场环境现状、未来发展趋势、成本费用支出情况以及减值准备发生期间等因素详细分析披露本次计提存货跌价准备和减值准备的具体依据,请年审会计师就相关会计确认发表专项意见。

3.投资性房地产:本期投资性房地产减少6504.81万元,请公司说明相关投资性房地产所涉及的项目以及减少的原因。

二、关于财务问题

4.营业外收入:报告期内公司营业外收入增加了2701.82万元,公司解释主要原因系子公司江阴新梅和上海新兰本期确认无需支付的工程款计入营业外收入所致,请公司说明无需支付的原因,将其确认为营业外收入是否符合相关会计准则的要求,请年审会计师就相关会计确认发表专项意见。

1.报告期期末基金投资组合情况:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	14,752,530.05	91.99
	其中:股票	14,752,530.05	91.99
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
3	资产管理计划	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,275,924.21	7.96
7	其他资产	8,384.79	0.05
8	合计	16,036,839.06	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合:

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	122,351.62	0.78
C	制造业	8,065,081.44	51.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	52,479.88	0.46
E	建筑业	90,911.84	0.62
F	批发和零售业	426,572.89	2.71
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	1,297,749.96	8.24
J	金融业	1,199,362.37	7.50
K	房地产业	1,291,236.02	8.26
L	租赁和商务服务业	194,566.99	1.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	469,360.39	2.96
O	国民教育、医药和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公业	-	-
R	文化、体育和娱乐业	371,716.52	2.36
S	综合	127,731.52	0.81
8	合计	13,715,131.64	87.13

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

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	20,222.00	0.15
B	采矿业	-	-
C	制造业	658,484.35	4.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	61,803.00	0.39
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	95,619.78	0.61
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	134,779.50	0.86
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	国民教育、医药和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社公业	42,348.78	0.27
R	文化、体育和娱乐业	21,141.00	0.13
S	综合	-	-
8	合计	1,057,396.41	6.39

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

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	000002	万科A	37,966	905,322.38	5.75
2	000654	际华集团	29,232	519,235.20	3.39
3	000001	平安银行	29,217	390,311.83	2.23
4	000033	荣盛集团	10,492	344,347.64	2.19
5	300104	乐视网	5,419	318,637.20	2.02
6	002236	大悦城	6,216	303,170.40	1.93
7	002415	海康威视	8,369	285,761.51	1.82
8	002241	歌尔声学	7,892	276,760.20	1.73
9	000663	中兴通讯	14,535	270,797.65	1.72
10	000029	招商局	19,777	265,196.65	1.68

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五名债券投资明细

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	600085	同德堂	4,500	260,745.00	1.28
2	300146	华信股份	3,754	144,259.00	0.92
3	002106	莱宝高科	7,738	105,234.92	0.64
4	601888	中国国航	1,700	100,827.00	0.66
5	603588	海航集团	2,429	85,865.15	0.55

4.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。

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。

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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

9.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。

10.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。

11.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。

12.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。

13.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。

14.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。

15.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。

16.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。

17.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。

18.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。

19.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。

20.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。

21.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。

22.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。

23.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。

24.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。

25.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。

26.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。

27.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。

28.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。

29.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。

30.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。

31.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。

32.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。

33.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。

34.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。

35.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。

36.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。

37.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。

38.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。

39.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。

40.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。

41.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。

42.报告