

# 东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 基金产品资料概要

编制日期：2020年8月26日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

## 一、产品概况

<b>基金简称</b>	东吴国企改革混合	<b>基金代码</b>	002159
<b>基金管理人</b>	东吴基金管理有限公司	<b>基金托管人</b>	中国建设银行股份有限公司
<b>基金合同生效日</b>	2015-12-30	<b>上市交易所及上市日期</b>	暂未上市
<b>基金类型</b>	混合型	<b>交易币种</b>	人民币
<b>运作方式</b>	开放式	<b>开放频率</b>	每个开放日
<b>基金经理</b>	周健	<b>开始担任的基金基金经理的日期</b>	2019-05-30
		<b>证券从业日期</b>	2006-08-01
<b>其他</b>			

## 二、基金投资与净值表现

### (一) 投资目标与投资策略

请投资者阅读《招募说明书》第九章了解详细情况

<b>投资目标</b>	本基金为混合型基金，通过灵活的资产配置，重点投资于在国内上市的国企改革主题的上市公司，在科学严格管理风险的前提下，力争为投资人提供长期稳定的投资回报。
<b>投资范围</b>	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、中小企业私募债、短期融资券、公司债、中期票据、次级债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许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）。 本基金可以参与融资业务。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为0%-95%；投资于国企改革主题的股票的比例不低于非现金基金资产的80%；债券、货币市场工具、银行存款、资产支持证券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的5%；权证投资占基金资产净值的比例不高于3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、

应收申购款等，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金投资于其他金融工具的比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势，采取兼顾风险预算管理的多层次复合投资策略，科学严谨规范资产配置谋求基金资产的长期稳定增长。

(一) 大类资产配置策略

(二) 股票精选策略

本基金的股票投资以深入的基本面研究为基础，从定性定量两个方面，精选国企改革主题上市公司中基本面良好、具有发展前景的优质上市公司进行投资，构建投资组合。

1、国企改革主题上市公司的界定

本基金所指国企改革包括国资监管体制改革、产权制度改革(如兼并重组、整合上市、混合所有制改革等)以及国企管理制度改革(如经营机制、激励机制改革等)等多种方式，国企改革主题上市公司界定为：

1) 已实施改革方案或具有改革预期的国有上市公司；

2) 因国企改革，而在行业准入门槛降低、国资布局调整、国资退出等相关主题受益的非国有上市公司。

未来若出现其他受益于国企改革进程的上市公司，本基金也应在深入研究的基础上，本着审慎的原则将其列入备选股票池。本基金将在备选股票池的基础上，以定性和定量相结合的方式，从价值和成长等因素对个股进行选择，精选估值合理且成长性好的上市公司进行投资。

2、个股精选

(三) 债券投资策略；(四) 中小企业私募债投资策略；(五) 资产支持证券投资策略；(六) 股指期货投资策略；(七) 权证投资策略

## 主要投资策略

## 业绩比较基准

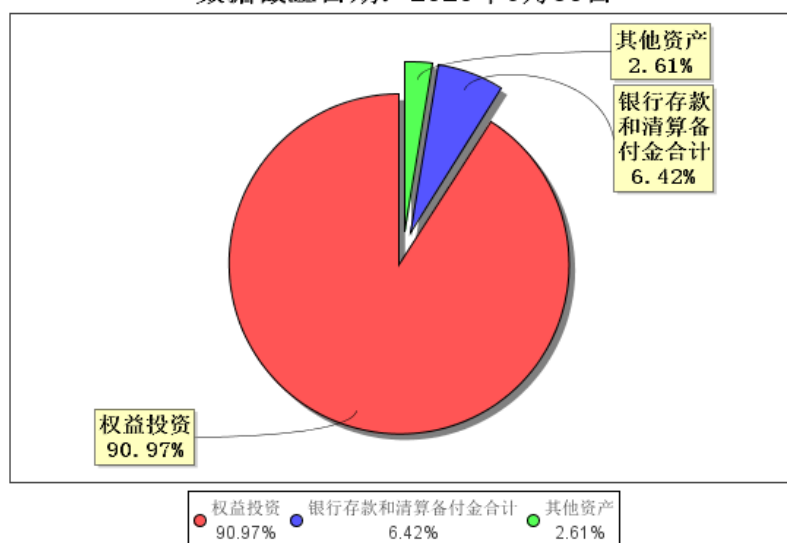
中证国有企业改革指数×50%+中债综合指数×50%

## 风险收益特征

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

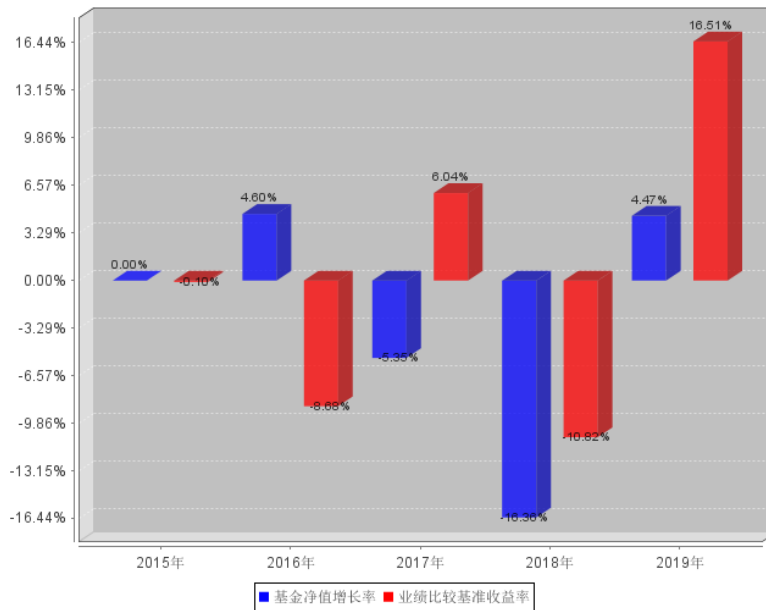
## (二) 投资组合资产配置图表

投资组合资产配置图表  
数据截止日期：2020年6月30日



**(三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图**

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



**三、投资本基金涉及的费用**

**(一) 基金销售相关费用**

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费 (前收费)	M < 100 万	1.50%	
	100 万 ≤ M < 200 万	1.20%	
	200 万 ≤ M < 500 万	0.80%	
	500 万 ≤ M < 1000 万	0.30%	
	M ≥ 1000 万	1000 元/笔	
赎回费	N < 7 天	1.50%	
	7 天 ≤ N < 30 天	0.75%	
	30 天 ≤ N < 1 年	0.50%	
	1 年 ≤ N < 2 年	0.25%	
	N ≥ 2 年	0.00%	

**(二) 基金运作相关费用**

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	1.50%
托管费	0.25%
其他费用	费用的计算方法及支付方式详见招募说明书及相关公告

注：本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

**四、风险揭示与重要提示**

**(一) 风险揭示**

本基金不提供任何保证。投资者可能损失本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

#### 1、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险。

#### 2、管理风险

基金运作过程中由于基金投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或公司内部失控而可能产生的损失。

3、职业道德风险：是指公司员工不遵守职业操守，发生违法、违规行为而可能导致的损失。

#### 4、流动性风险

本基金属于开放式基金，基金份额可以在基金合同约定的时间和场所进行申购和赎回，因此会面临一定的流动性风险。所谓流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。在基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形，从而导致基金仓位调整的困难，引发流动性风险，甚至影响基金份额净值。

#### 5、合规性风险

6、投资管理风险：(1) 本基金为混合型基金，其预期收益和风险均高于货币型基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的较高风险、较高收益的基金类型；(2) 选股方法、选股模型风险；(3) 基金经理主观判断错误的风险；(4) 其他风险。

#### 7、投资股指期货的风险

本基金参与股指期货交易。股指期货交易采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股指期货标的指数微小的变动就可能使投资者权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。此外，交易所对股指期货的交易限制与规定会对基金投资股指期货的策略执行产生影响，从而对基金收益产生不利影响。

#### 8、中小企业私募债券风险

本基金投资中小企业私募债券，中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

### (二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。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财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

### 五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：[www.scfund.com.cn](http://www.scfund.com.cn)][客服电话:400-821-0588]

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料