

东吴双三角股票型证券投资基金 基金产品资料概要

编制日期：2021年1月25日

送出日期：2021年1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

基金简称	东吴双三角股票	基金代码	A类：005209 C类：005210
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
基金合同生效日	2017-12-05	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	徐增	开始担任本基金基金经理的日期	2021-1-22
其他		证券从业日期	2009-07-27

二、基金投资与净值表现

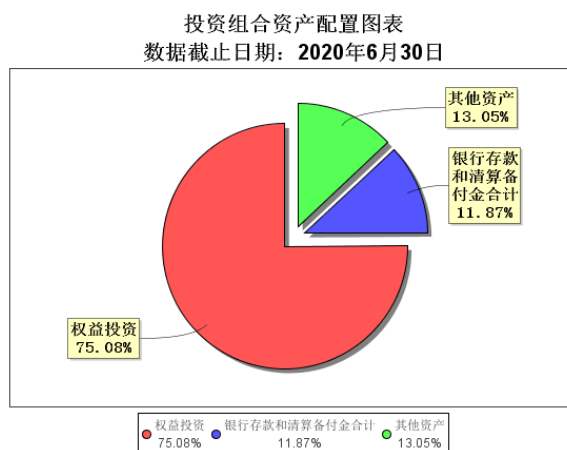
(一) 投资目标与投资策略

请投资者阅读《招募说明书》第九章了解详细情况

投资目标	本基金主要投资于注册地、办公地点所在地或主营业务所在地在长江三角洲地区、珠江三角洲地区或直接受益于上述两地区经济发展的上市公司股票，在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资范围	本基金的投资范围主要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）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资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”）、债券（含国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、短期融资券、超级短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货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）。 基金的投资组合比例为：股票资产（包括国内依法发行上市的股票及港股通标的股票）不低于基金资产的80%，其中对港股通标的股票的投资比例不超过基金股票资产的50%，投资于“双三角”相关主题的证券资产合计不低于非现金基金资产的80%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的保证金以后，

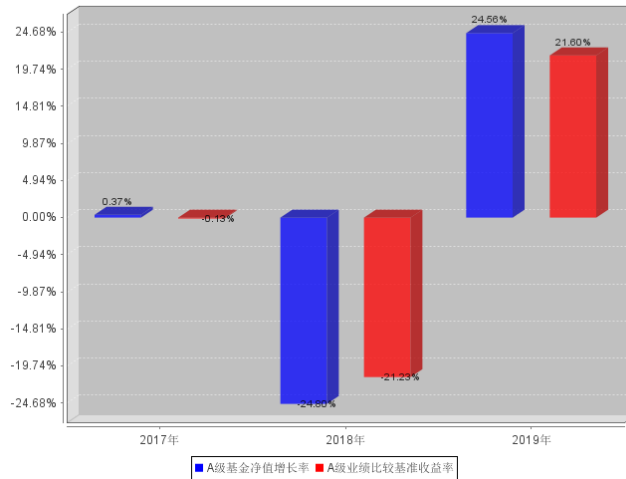
	<p>基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>本基金对于注册地、办公地点所在地或主营业务所在地在长江三角洲地区、珠江三角洲地区（即“双三角”）或直接受益于上述两地区经济发展的个股选择将采用定性分析与定量分析相结合的方法，选择其中具有优势的上市公司进行投资。</p> <p>1) 定性方式</p> <p>根据国务院 2010 年批准的《长江三角洲地区区域规划》，长江三角洲（以下简称长三角）包括上海市、江苏省和浙江省。长三角地区是中国第一大经济区，是中央政府定位的中国综合实力最强的经济中心、亚太地区重要国际门户和全球重要的先进制造业基地。</p> <p>根据国务院于 2008 年审议通过的《珠江三角洲地区改革发展规划纲要》，珠江三角洲（以下简称珠三角）范围是，以广东省的广州、深圳、珠海、佛山、江门、东莞、中山、惠州和肇庆市为主体，辐射泛珠江三角洲区域，并将与港澳紧密合作的相关内容纳入规划。</p> <p>2) 定量方式</p> <p>筛选出在公司治理、财务及管理品质上符合基本品质要求的公司，构建备选股票池。主要筛选指标包括：</p> <p>A、成长性指标：营业利润增长率、净利润增长率和收入增长率等；B、财务指标：毛利率、营业利润率、净资产收益率、净利率、经营活动净收益/利润总额等；C、估值指标：市盈率（PE）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、市销率（PS）和总市值。</p> <p>3) 港股投资策略</p>
主要投资策略	
业绩比较基准	<p>中证长三角龙头企业指数收益率×30%+中证珠三角沿海区域发展主题指数收益率×30%+恒生综合指数收益率×20%+中债总指数收益率×20%</p>
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。</p> <p>本基金除了投资于 A 股市场，还可以在法律法规规定的范围内投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港股票市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p>

（二）投资组合资产配置图表

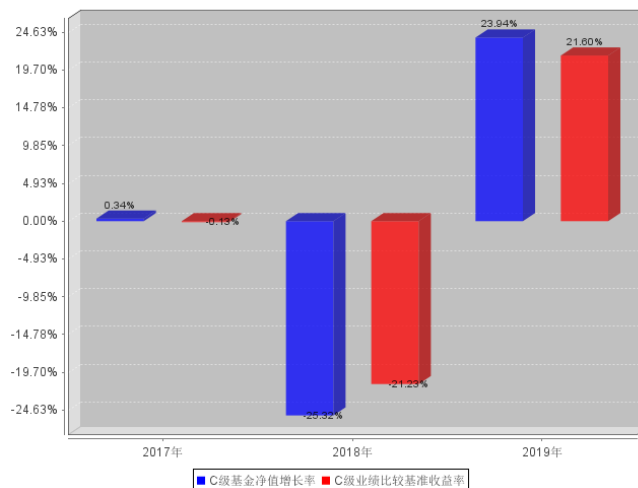


(三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的对比图

A级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



C级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
A 类份额申购费(前收费)	M < 50 万	1.50%	
	50 万 ≤ M < 300 万	0.75%	
	300 万 ≤ M < 500 万	0.50%	
	M ≥ 500 万	1000 元/笔	
A 类份额赎回费	N < 7 天	1.50%	
	7 天 ≤ N < 30 天	0.75%	
	30 天 ≤ N < 180 天	0.50%	

	N ≥ 180 天	0%
C 类份额赎回费	N < 7 天	1.50%
	7 天 ≤ N < 30 天	0.50%
	N ≥ 30 天	0%

(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/费率
管理费	1.50%
托管费	0.25%
销售服务费（C类）	0.50%
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。

本基金主要风险包括市场风险、管理风险、流动性风险、交易对手违约风险、投资港股通标的股票的风险及其他风险等。本基金特有风险如下：

- 1、本基金投资范围包括股指期货、国债期货等金融衍生品，金融衍生品投资可能给本基金带来额外风险，包括杠杆风险、期货价格与基金投资品种价格的相关度降低带来的风险等，由此可能增加本基金净值的波动性。
- 2、投资资产支持证券的特定风险。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。

(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。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

本基金的争议解决处理方式为仲裁。具体仲裁机构和仲裁地点详见本基金合同的具体约定。

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][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