

东吴沪深 300 指数型证券投资基金

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

基金简称	东吴沪深 300 指数	基金代码	A 类：165806 C 类：165810
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	2018-07-11	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	周健	开始担任本基金基金经理的日期	2020-01-18
		证券从业日期	2006-08-01
其他	东吴沪深 300 指数型证券投资基金由东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF)变更注册而来。		

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》第八章了解详细情况

投资目标	本基金采用被动式投资策略，通过紧密跟踪标的指数，力争控制本基金的份额净值增长率与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
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，以沪深 300 指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、权证、债券（含国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、央行票据、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 本基金投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，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，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。
主要投资策略	1、本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组

合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,以复制和跟踪标的指数。由于标的指数编制方法调整、成份股及其权重发生变化(包括配送股、增发、临时调入及调出成份股等)的原因,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。

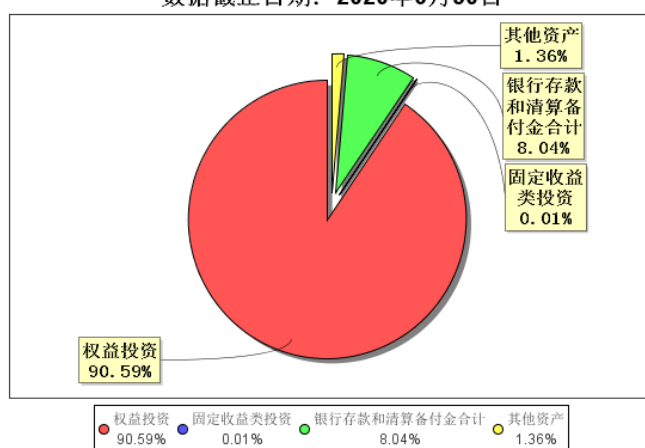
2、股票投资策略;3、债券投资策略;4、股指期货投资策略;5、资产支持证券投资策略;6、权证投资策略;7、可转换债券/可交换债券投资策略

业绩比较基准 沪深 300 指数收益率×95%+ 银行活期存款利率(税后)×5%。

风险收益特征 本基金为股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

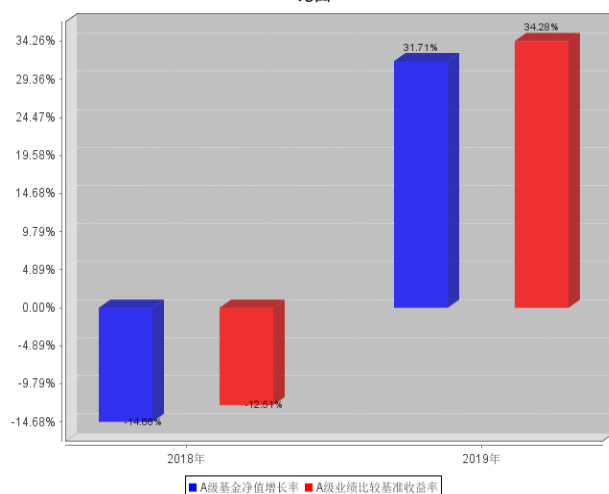
(二) 投资组合资产配置图表

投资组合资产配置图表
数据截止日期: 2020年6月30日

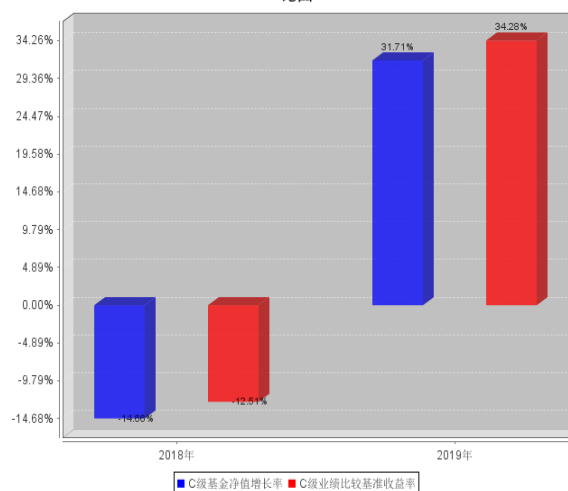


(三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的对比图

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	1.20%	
	50 万 ≤ M < 200 万	0.80%	
	200 万 ≤ M < 500 万	0.40%	
	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	0.50%
托管费	0.10%
销售服务费 (C 类)	0.20%
其他费用	1、《基金合同》生效后的标的指数许可使用费 0.02%； 2、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、策略风险及其他风险等。本基金特有风险如下：

(1) 本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪沪深 300 指数，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。在正常市场情况下，力争控制本基金的份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

因此本基金特有的风险主要包括：

1) 市场系统风险

本基金为股票型基金，重点投资于沪深 300 指数成份股及其备选成份股。在具体投资管理中，本基金可能面临沪深 300 指数成份股以及备选股所具有的特有风险，也可能由于跟踪标的为市场代表性指数而面临较高的系统性风险。

2) 指数化投资风险

本基金的跟踪组合的构建和日常管理，以对标的指数尽可能小的跟踪误差为投资目标，因此其也具有普通股票型基金所不具备的特有风险。但在以下条件下可能会出现跟踪误差较大从而造成与标的指数风险-收益特征不匹配的风险：

①标的指数成份股及其权重的定期或不定期调整；②标的指数成份股的配股、增发、分红等公司行为；③基金买入、卖出股票时产生的交易成本；④申购、赎回、转换等业务因素带来的跟踪误差；⑤基金保留部分现金资产的造成的跟踪误差；⑥基金的管理费、托管费和指数许可使用费带来的跟踪误差；⑦指数成份股停牌、摘牌，成份股涨、跌停板等因素带来的组合偏差；⑧其他因素引起的跟踪误差。

3) 标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的目标指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

这些特有的风险因素可能使本基金的业绩表现在特定时期落后于其它股票型基金，并可能使本基金的实际组合风险-收益特征与标的指数产生偏离或差异。

(2) 本基金可投资于资产支持证券，面临与资产支持证券相关的风险，主要包括资产支持证券信用增级措施相关风险、资产支持证券的利率风险、资产支持证券的流动性风险、评级风险以及与基础资产相关的原始权益人破产、现金流预测等风险，上述风险可能对基金收益产生不利影响。

(3) 本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资股指期货所面临的主要风险是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险、和操作风险。

(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][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