

东吴兴弘一年持有期混合型证券投资基金

基金产品资料概要

编制日期：2022年08月09日

送出日期：2022年08月10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	东吴兴弘一年持有期混合	基金代码	016097
下属基金简称	东吴兴弘一年持有期混合A		东吴兴弘一年持有期混合C
下属基金代码	016097		016098
下属前端交易代码	-		-
下属后端交易代码	-		-
基金管理人	东吴基金管理有限公司	基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日	-	上市交易所及上市日期	暂未上市 -
基金类型	混合型（偏股混合型）	交易币种	人民币
运作方式	其他开放式	开放频率	本基金每个开放日开放申购，但投资人每笔认购/申购的基金份额需至少持有满一年，在一年锁定持有期内不能提出赎回申请。
基金经理	陈军	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	1998-04-10
其他	《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现前述情形的，基金管理人在履行适当程序后，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会，但应依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。		

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	本基金在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。
投资范围	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（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、可转债

换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、次级债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、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）。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。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的50%）；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债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。

若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

主要投资策略

1、资产配置策略

2、股票投资策略

（1）行业配置策略

本基金将自上而下地进行行业遴选，综合考虑宏观经济环境、国家产业发展政策及不同行业的发展空间、景气周期、竞争格局、上下游供需情况等因素，精选受益于宏观经济和社会发展方向的盈利趋势向好、发展前景良好、具有良好投资价值的行业进行重点配置，并根据经济发展变化趋势进行动态调整。

（2）个股选择策略

本基金将定性研究方法和定量研究方法相结合，对相关上市公司的投资价值进行综合评估，精选具备较强竞争优势的上市公司作为投资标的。

1）定量评估：

本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的成长性指标、盈利质量指标和估值指标等进行定量分析，以挑选具有相对优势的个股。

①成长性评估：筛选相对全市场和行业具有较好发展潜力与发展速度的公司。采用指标包括但不限于净利润增长率或营业收入增长率等指标。

②质量评估：筛选具有良好盈利质量的公司。采用指标包括但不限于净资产收益率（ROE）、资本回报率（ROIC）或经营性现金流占净利润比例等指标。

③估值评估：筛选估值合理的公司。采用指标包括但不限于市盈率（PE）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、市销率（PS）或市净率（PB）等指标。

2）定性评估：

本基金将综合考虑上市公司的核心业务竞争力、行业发展前景、市场地位、研发投入、创新属性等因素，寻找核心竞争力能持续增长并能够带动公司形成更深护城河的具有高质量增长的公司。通过实地调研、与目标公司管理层进行深入沟通等方法，本基金将综合考评公司的治理结构、管理层工作能力、经营情况等，甄选拥有优秀管理层、经营稳健的上市公司。在比较投资标的的市场价格与内在投资价值后，进一步精选风险调整后收益较高的个股构建股票投资组合，并根据市场发展阶段、公司基本面变化动态优化调整投资组合。

（3）港股通标的股票投资策略

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有相对优势的上市公司纳入本基金的股票投资组合。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资

于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

3、债券投资策略

4、资产支持证券投资策略

5、股指期货投资策略

6、国债期货投资策略

业绩比较基准 中证500指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+中债综合指数（全价）收益率×20%

风险收益特征 本基金是混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

本基金投资港股通标的股票时，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

（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比较图

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：

东吴兴弘一年持有期混合 A

费用类型	份额(S)或金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率	备注
认购费	M<1,000,000	1.20%	
	1,000,000≤M<2,000,000	0.80%	
	2,000,000≤M<5,000,000	0.40%	
	M≥5,000,000	1000元/笔	
申购费（前收费）	M<1,000,000	1.50%	-
	1,000,000≤M<2,000,000	1.00%	-
	2,000,000≤M<5,000,000	0.60%	-
	M≥5,000,000	1000元/笔	-
赎回费	本基金不收取赎回费，但对每份基金份额设置一年锁定持有期，基金份额持有人仅可在该基金份额锁定持有期届满后的下一个工作日起办理基金份额赎回。		

东吴兴弘一年持有期混合 C

费用类型	份额(S)或金额(M)/持有期限(N)	收费方式/费率	备注
赎回费	本基金不收取赎回费，但对每份基金份额设置一年锁定持有期，基金份额持有人仅可在该基金份额锁定持有期届满后的下一个工作日起办理基金份额赎回。		

（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%
销售服务费	东吴兴弘一年持有期	—
	混合A	
	东吴兴弘一年持有期	0.40%
	混合C	
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、合规性风险及其他风险等。本基金特有风险如下：

（1）锁定持有期届满前不能赎回基金份额的风险

本基金设置锁定持有期，每份基金份额的锁定持有期为一年，相应基金份额在锁定持有期内不可办理赎回及转换转出业务。因此基金份额持有人面临在锁定持有期内不能赎回基金份额的风险。

（2）投资港股通标的股票的风险

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。

本基金资产投资于港股通标的股票，可能使本基金面临港股通交易机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

1）市场联动的风险。由于香港市场上外汇资金可以自由流动，海外资金的流动与港股价格之间表现出高度相关性，因此，投资者在参与港股市场交易时受到全球宏观经济和货币政策变动导致的系统风险相对更大。

2）股价波动的风险。由于港股市场实行T+0交易机制，而且个股不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富，因此，香港市场个股的股价受到意外事件驱动的影响而表现出股价波动的幅度相对A股更为剧烈。

3）个股的流动性风险。在香港市场，部分中小市值股票成交量相对较少，流动性较为缺乏，投资者持有此类股票，可能因缺乏交易对手方面临小量抛盘即导致股价大幅下降的风险。

4）汇率风险。本基金投资港股通标的股票时可能会引发汇率风险。由于本基金的记账货币是人民币，因此在投资港股通标的股票时，除了证券本身的收益/损失外，人民币的升值会给基金资产带来额外的损失，从而对基金净值和投资者收益产生影响。

5）交易日不连贯风险。只有沪港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日；香港出现台风、黑色暴雨或者联交所规定的其他情形时，联交所将可能停市；出现上交所证券交易服务公司认定的交易异常情况时，上交所证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务。

（3）投资股指期货、国债期货的特定风险

本基金可投资于股指期货、国债期货，股指期货、国债期货作为金融衍生品，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资股指期货、国债期货所面临的风险主要是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险和操作风险。具体为：

1）市场风险是指由于股指期货、国债期货价格变动而给投资者带来的风险。市场风险是股指期货、

国债期货投资中最主要的风险。

2) 流动性风险是指由于股指期货、国债期货合约无法及时变现所带来的风险。

3) 基差风险是指股指期货、国债期货合约价格和指数价格之间的价格差的波动所造成的风险，以及不同股指期货、国债期货合约价格之间价格差的波动所造成的期现价差风险。

4) 保证金风险是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持股指期货、国债期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

5) 信用风险是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。

6) 操作风险是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

此外，由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，并且其定价相当复杂，不适当的估值也有可能使基金资产面临损失风险。

(4) 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。

(5) 基金合同提前终止风险

《基金合同》生效后，连续50个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人在履行适当程序后，基金合同自动终止，不需召开基金份额持有人大会。

(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

六、其他情况说明

—