

# 东吴行业轮动混合型证券投资基金

## 基金产品资料概要（更新）

编制日期：2023年8月16日

送出日期：2023年8月17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     | 东吴行业轮动混合   | 基金代码           | 580003     |
| 下属基金简称   | 东吴行业轮动混合A  |                | 东吴行业轮动混合C  |
| 下属基金代码   | 580003     |                | 011240     |
| 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          | 华夏银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日  | 2008-04-23 | 上市交易所及上市日期     | 暂未上市 -     |
| 基金类型     | 混合型        | 交易币种           | 人民币        |
| 运作方式     | 普通开放式      | 开放频率           | 每个开放日      |
| 基金经理     | 赵梅玲        | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023-08-15 |
|          |            | 证券从业日期         | 2007-07-23 |

注：东吴行业轮动混合型证券投资基金自2021年1月21日起增设C类基金份额。

### 二、基金投资与净值表现

#### （一）投资目标与投资策略

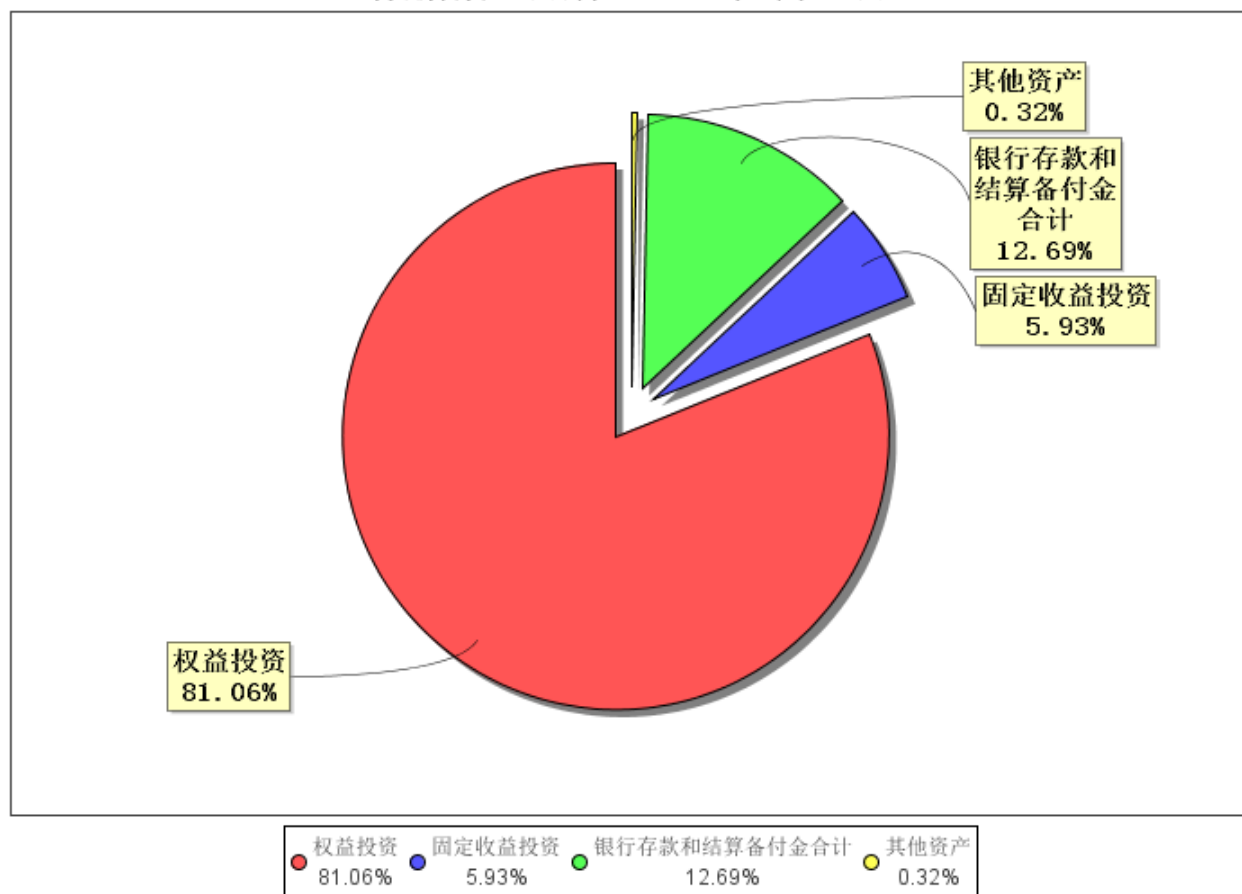
请投资者阅读《招募说明书》第十章了解详细情况

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金为混合型基金，通过对行业轮动规律的把握，侧重投资于预期收益较高的行业，并重点投资具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。                                                                                                                                                                                         |
| 投资范围 | <p>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、债券、权证、以及法律法规或经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的60%-95%，债券投资比例为基金资产的0-35%，权证投资比例不高于基金资产净值的3%，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>本基金根据行业轮动规律，80%以上的非现金基金资产投资于具有“三重优势”的股票、债券、权证等资产。</p> |

|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|---------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>主要投资策略</b> | <p>本基金采取自上而下策略，根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析，确定基金资产在股票、衍生产品、债券和现金上的配置比例。采取行业轮动策略，对股票资产在不同行业之间进行适时的行业轮动，动态增大预期收益率较高的行业配置，减少预期收益率较低的行业配置。对于股票投资策略，重点投资具有成长优势、估值优势和竞争优势的上市公司股票，追求超额收益。</p> <p>1、行业配置策略</p> <p>本基金行业配置策略是通过东吴行业轮动识别模型实现的，东吴行业轮动识别模型从行业利润增长趋势和行业动态估值水平两个维度构建。以A股整体估值水平和A股整体利润增长率作为基准，同时结合国际估值的比较，将《东吴基金管理公司行业分类》中所有行业分成四类。</p> <p>2、选股策略</p> <p>本基金，首先从公司利润增长和股票估值水平两个维度，精选出持续增长，并且具有估值优势的股票作为初选股票池。在此基础上，本基金根据东吴企业竞争优势评价体系，选出具有竞争优势的股票作为本基金的股票池。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>4、权证投资策略</p> |
| <b>业绩比较基准</b> | 75%*沪深300指数+25%*中证全债指数。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| <b>风险收益特征</b> | <p>本基金是一只进行主动投资的混合型基金，其风险和预期收益均高于货币型基金和债券型基金，低于股票型基金，在证券投资基金中属于风险较高、预期收益较高的基金产品。前款有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括基金管理人直销机构和其他销售机构）根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同。本基金的风险等级可能有相应变化，具体风险评级结果应以销售机构的评级结果为准。</p>                                                                                                                                                                                            |

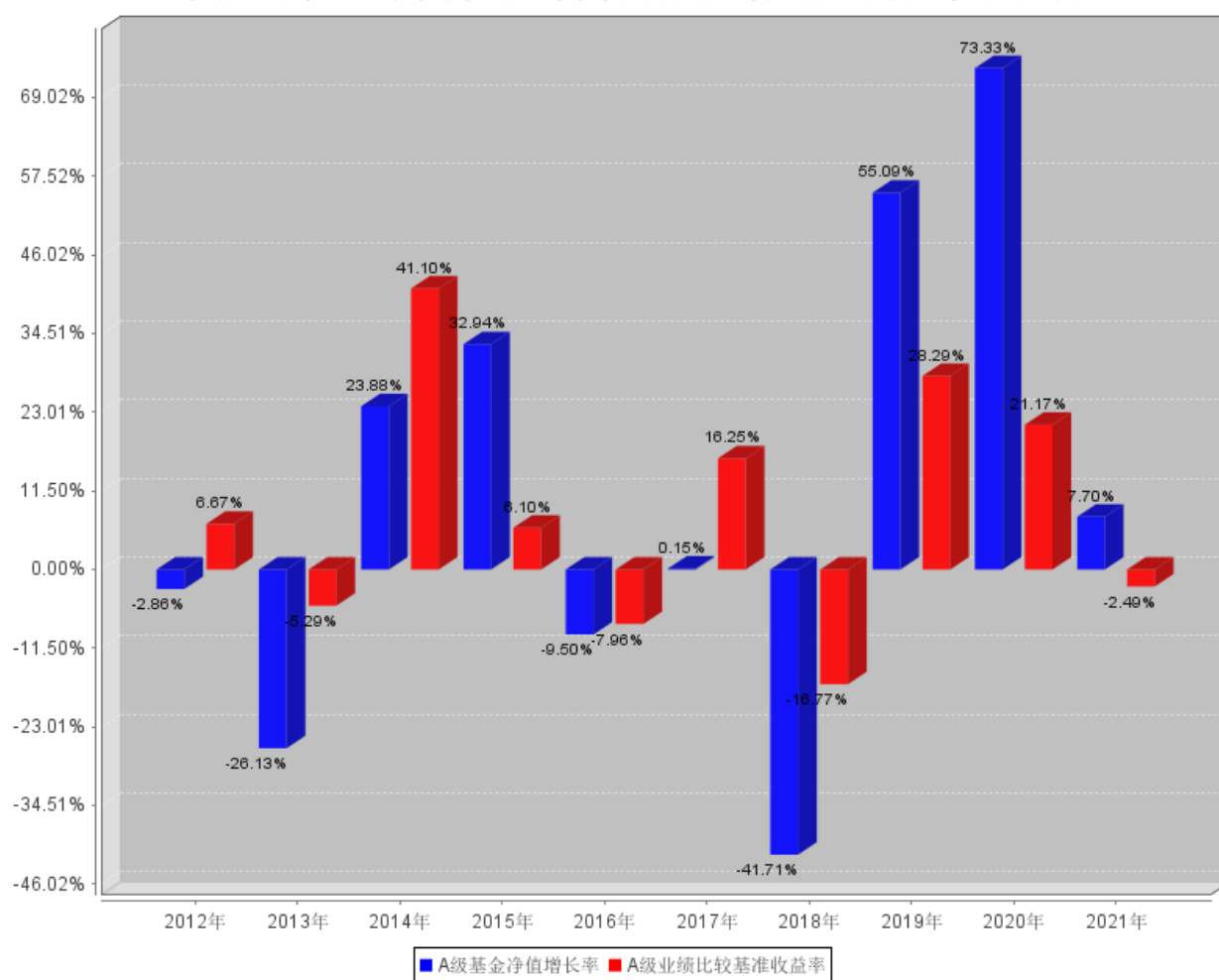
## （二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表  
数据截止日期：2022年6月30日

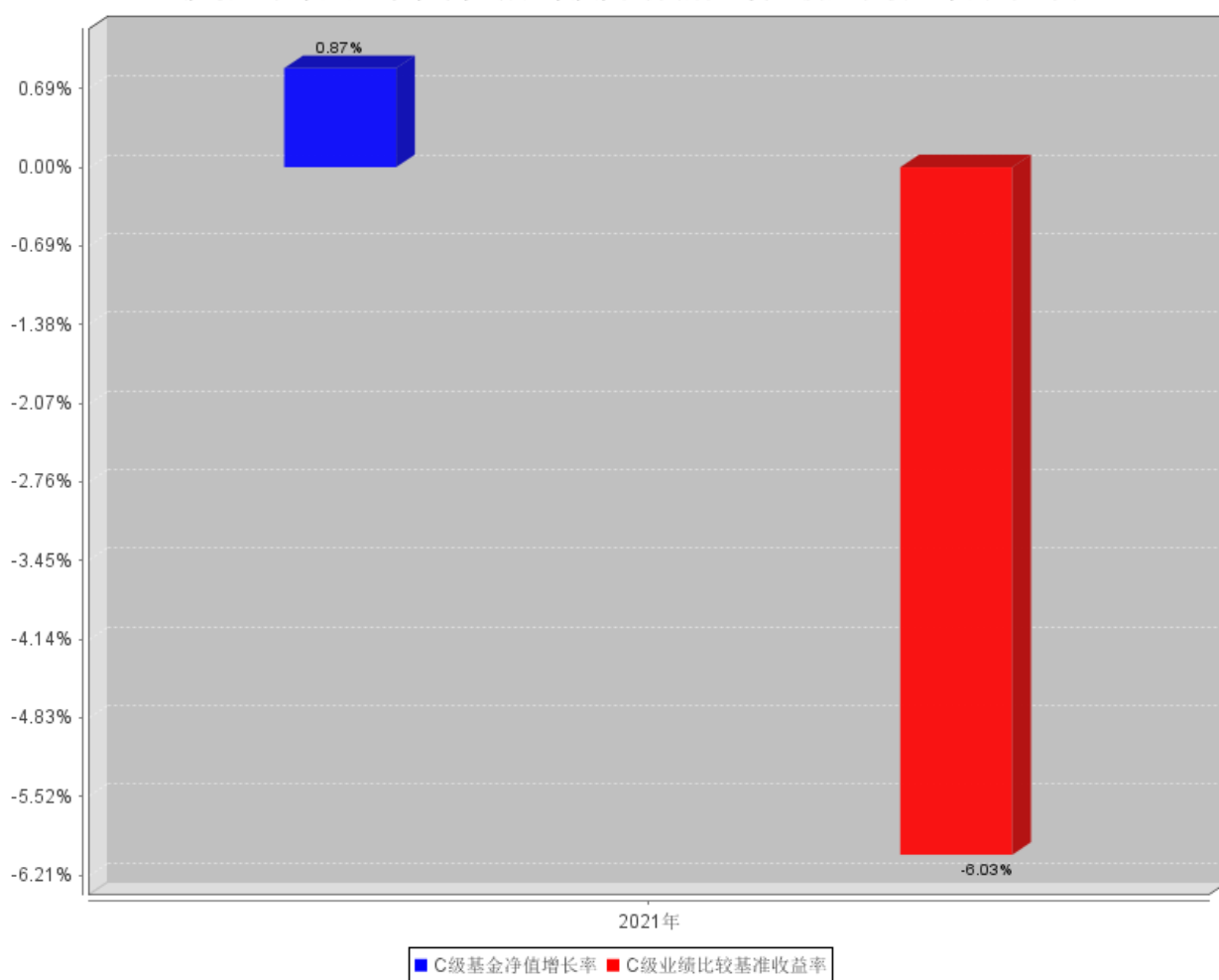


（三）自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

A级最近十年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级最近十年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



- 1、业绩表现截止日期2021年12月31日。基金过往业绩不代表未来表现。
- 2、比较基准=75%\*沪深300指数+25%\*中证全债指数
- 3、本基金于2021年1月21日开始分为A、C两类。

### 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：

东吴行业轮动混合 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 |
|----------|-----------------------|---------|----|
| 申购费（前收费） | M<1,000,000           | 1.5%    | —  |
|          | 1,000,000≤M<2,000,000 | 1.2%    | —  |
|          | 2,000,000≤M<5,000,000 | 0.8%    | —  |
|          | M≥5,000,000           | 1000元/笔 | —  |
| 赎回费      | N<7天                  | 1.50%   | —  |
|          | 7天≤N≤365天             | 0.50%   | —  |
|          | 1年<N≤2年               | 0.25%   | —  |
|          | N>2年                  | 0%      | —  |

## 东吴行业轮动混合 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  | N<7天                | 1.50%   | —  |
|      | 7天≤N<30天            | 0.5%    | —  |
|      | 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/年费率                 |
|------------|--------------------------|
| 管理费        | 1.20%                    |
| 托管费        | 0.20%                    |
| 东吴行业轮动混合   | —                        |
| 销售服务费 A    | —                        |
| 东吴行业轮动混合 C | 0.40%                    |
| 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

金融市场价格受经济因素、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，产生风险。

## 2、管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金可能因为基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等因素影响基金收益水平。

## 3、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。

## 4、策略风险

本基金存在投资策略风险，即本基金的业绩表现不一定领先于市场平均水平。另外，在精选个股的实际操作过程中，基金管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断，其精选出的个股的业绩表现不一定持续优于其他股票。

## 5、投资科创板股票的风险

本基金可投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

## 6、其他风险

## （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](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

## 六、其他情况说明

—