

东吴消费成长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9月12日

送出日期：2023年9月13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	东吴消费成长混合	基金代码	012971
下属基金简称	东吴消费成长混合A		东吴消费成长混合C
下属基金代码	012971		012972
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	交通银行股份有限公司
基金合同生效日	2021-09-14	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	2021-09-14
		证券从业日期	2007-07-23
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	在严格控制风险的前提下，本基金通过股票与债券等资产的合理配置，精选消费主题的相关上市公司股票进行投资，力争基金资产的持续稳健增值。
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%）；投资于本基金定义的消费成长主题相关证券的资产比例不低于非现金基金资产的80%；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。

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

（一）资产配置策略

（二）股票投资策略

1、消费成长主题的界定

本基金主要投资于消费行业相关上市公司。着眼于在中国经济增长带来消费升级驱动背景下，可以通过提供商品和服务满足消费者日益提升的生活品质要求的相关行业，挖掘传统及新兴消费所带来的投资机会。

本基金定义的消费成长主题主要是满足居民衣食住行、文娱、健康、教育等消费制造和消费服务业及与其密切相关上下游产业的上市公司，包括但不限于食品饮料、农林牧渔、纺织服装、医药生物、房地产、建筑材料、交通运输、家用电器、汽车、商贸零售、电子、计算机、通信、传媒、休闲服务、教育、日用化学品等行业。

同时本基金将对消费行业的发展进行密切跟踪，随着经济增长及产业转型的进一步发展变化，消费行业的外延将可能会不断扩大或相应调整，基金管理人在履行适当程序后有权对上述主题界定的标准及涵盖的相关行业范围进行调整，并在更新的招募说明书中进行公告。

2、个股精选策略

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。

3、港股通投资策略

（三）债券投资策略

（四）资产支持证券投资策略

（五）股指期货投资策略

业绩比较基准

中证内地消费主题指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+中债综合指数（全价）收益率×20%

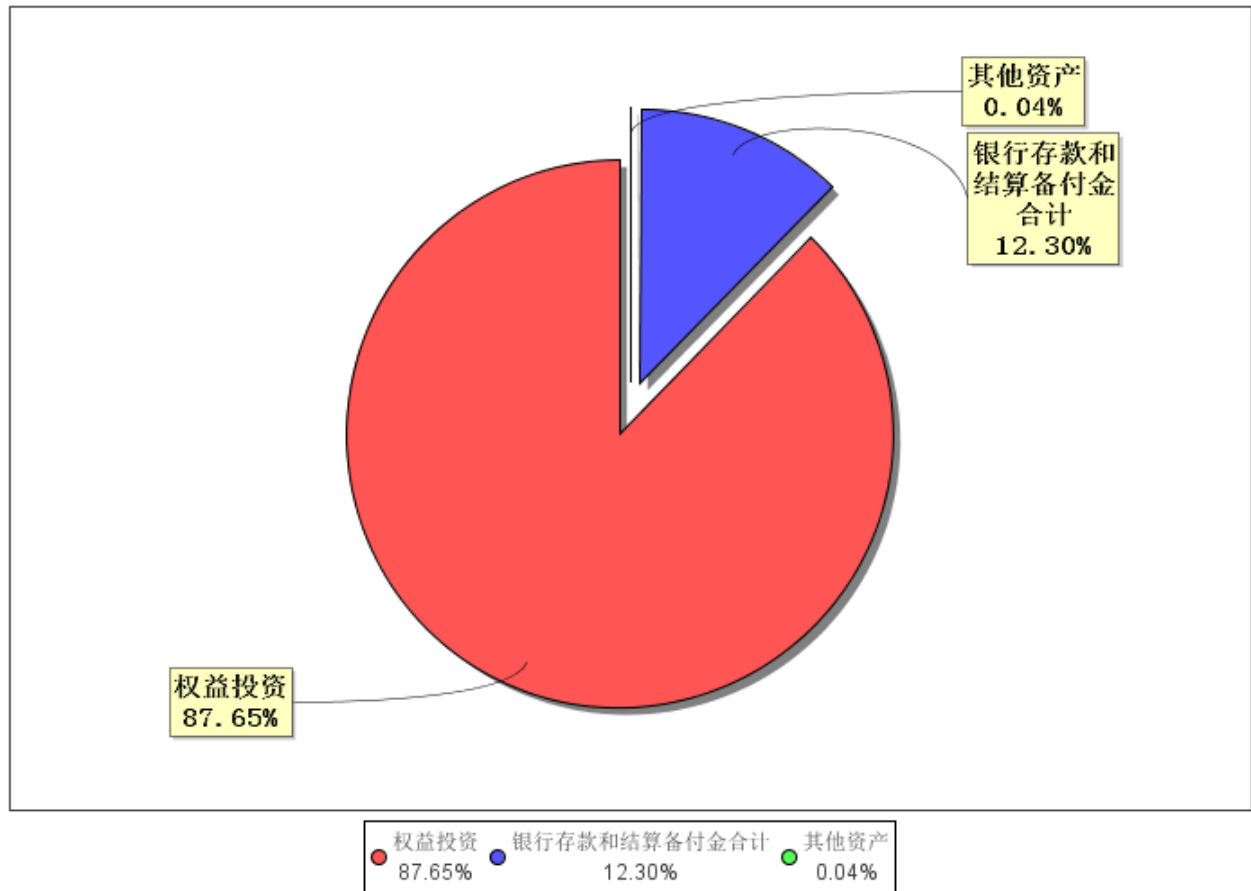
风险收益特征

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。

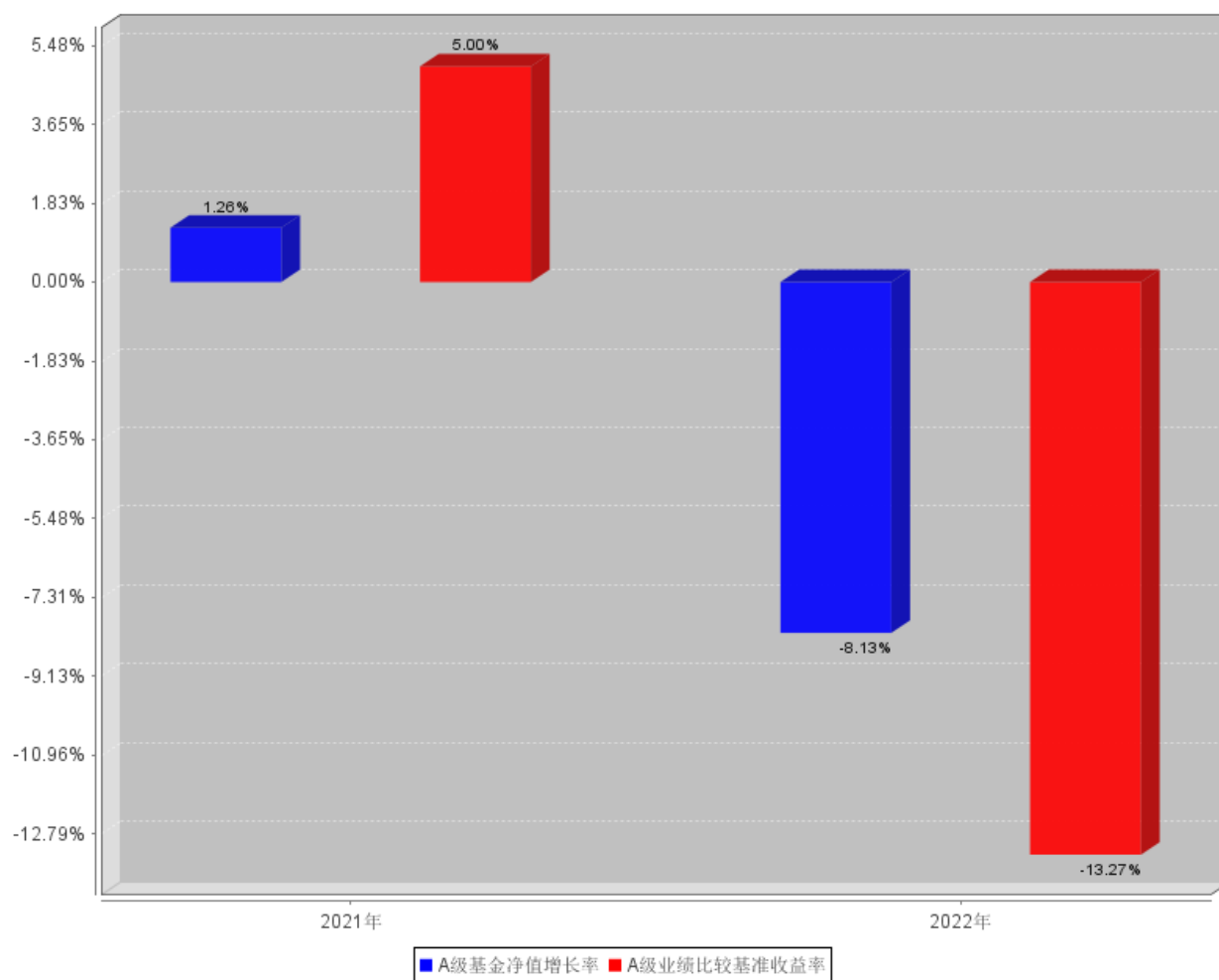
（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表
数据截止日期：2023年6月30日

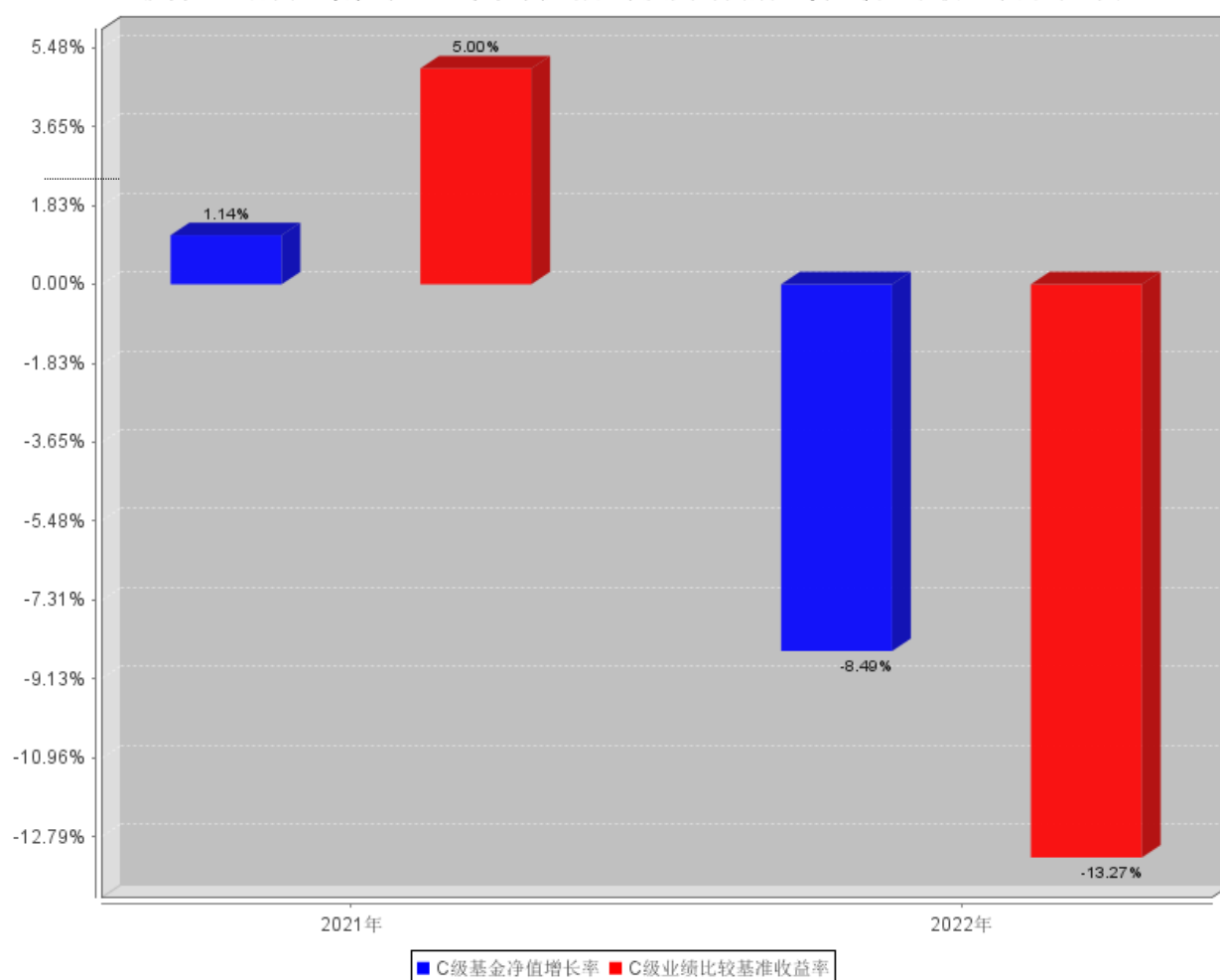


（三）自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

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



1、业绩表现截止日期2022年12月31日。基金过往业绩不代表未来表现。

2、业绩比较基准=中证内地消费主题指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+中债综合指数（全价）收益率×20%。

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：

东吴消费成长混合 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	N<7日	1.50%	—

7日 $\leq$ N $<$ 30日	0.75%	—
30日 $\leq$ N $<$ 180日	0.50%	—
N $\geq$ 180日	0%	—

东吴消费成长混合 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日	1.50%	—
	7日 $\leq$ N $<$ 30日	0.50%	—
	N $\geq$ 30日	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%
东吴消费成长混合	—
销售服务费 A	—
东吴消费成长混合 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。

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）投资港股通标的股票的风险

本基金投资港股通标的股票，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，会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。

（2）投资股指期货的特定风险

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，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价格变动而给投资者带来的风险。市场风险是股指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。

（3）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。

（4）基金合同提前终止风险。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。

（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。投资科创板股票存在的风险包括：

1）市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。

科创板个股上市前五日无涨跌停限制，第六日开始涨跌幅限制在正负20%以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

2）流动性风险

科创板整体投资门槛较高，个人投资者必须满足交易满两年并且资金在50万以上才可参与，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构持有个股大量流通盘导致个股流动性较差，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

3）信用风险

科创板试点注册制，对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市制度，科创板个股存在退市风险。

4) 集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

5) 系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

6) 政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

（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

—