

东吴嘉睿 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金

基金产品资料概要

编制日期：2026 年 7 月 10 日

送出日期：2026 年 7 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	东吴嘉睿 6 个月持有混合发起式	基金代码	028311
下属基金简称	东吴嘉睿 6 个月持有混合发起式 A	下属基金交易代码	028311
下属基金简称	东吴嘉睿 6 个月持有混合发起式 C	下属基金交易代码	028312
基金管理人	东吴基金管理有限公司	基金托管人	平安银行股份有限公司
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	交易币种	人民币
运作方式	其他开放式	开放频率	每个开放日开放申购，但对每份基金份额设置 6 个月的最短持有期
基金经理	杜澄楷	开始担任本基金基金经理的日期	—
		证券从业日期	2008 年 8 月 1 日
其他	《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，本基金将根据《基金合同》的约定进行基金财产清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时有效的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。 《基金合同》生效满三年后继续存续的，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，基金管理人将终止基金合同，并按照基金合同约定程序进行清算，此事项不需要召开基金份额持有人大会。 法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		

注：本基金为偏债混合型基金。本基金投资于股票（含存托凭证）、可转换债券（含分离交易可转债）和可交换债券的比例合计占基金资产的 10%-30%，其中投资于可转换债券（含分离交易可转债）及可交换债券的比例不超过基金资产的 20%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%，投资于境内股票资产的比例合计不低于基金资产的 10%。因此，本基金理论上预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

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	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现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，包括国内依法发行或上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、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，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为：本基金投资于股票（含存托凭证）、可转换债券（含分离交易可转债）和可交换债券的比例合计占基金资产的 10%-30%，其中投资于可转换债券（含分离交易可转债）及可交换债券的比例不超过基金资产的 20%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%，投资于境内股票资产的比例合计不低于基金资产的 10%。每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。
主要投资策略	（一）资产配置策略 （二）股票投资策略 1、A 股投资策略 2、港股通标的股票投资策略 3、存托凭证投资策略 （三）债券投资策略 1、利率策略与久期管理 2、信用债券投资策略 3、类属配置策略 4、可转换债券/可交换债券投资策略 （四）股指期货投资策略 （五）国债期货投资策略
业绩比较基准	中债-综合全价(总值)指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*12% +活期存款基准利率*5%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*3%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，理论上预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资于港股通标的股票时，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。

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：

东吴嘉睿6个月持有混合发起式 A

费用类型	份额(S)或金额(M) /持有期限(N)	收费方式/费率
认购费	M<1000000 元	0.50%
	1000000 元≤M<3000000 元	0.40%
	3000000 元≤M<5000000 元	0.30%
	M≥5000000 元	1,000 元/笔
申购费 (前收费)	M<1000000 元	0.50%
	1000000 元≤M<3000000 元	0.40%
	3000000 元≤M<5000000 元	0.30%
	M≥5000000 元	1,000 元/笔

(1) 投资者通过直销机构认购/申购本基金 A 类基金份额, 不收取认购/申购费用; 通过其他销售机构认购/申购本基金 A 类基金份额, 收取认购/申购费用; C 类基金份额不收取认购/申购费用。

(2) 本基金不收取赎回费, 但对每份基金份额设置 6 个月的最短持有期, 基金份额持有人仅可自每份基金份额的最短持有期到期日的下一工作日(含)起, 提出赎回申请或转换转出申请。

(3) 基金认购费、申购费不列入基金财产, 主要用于基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

(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/年费率或金额		收取方
管理费	年费率	0.60%	基金管理人和销售机构
托管费	年费率	0.10%	基金托管人
销售服务费	东吴嘉睿 6 个月 持有混合发起式 C	0.40%	销售机构
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: (1) 本基金交易证券等产生的费用和税负, 按实际发生额从基金资产扣除。

(2) 审计费用、信息披露费为基金整体承担费用, 非单个基金份额类别费用, 且年金额为预估值, 最终实际金额以基金定期报告披露为准。

(3) 对于投资者通过直销机构认购/申购的 C 类基金份额, 计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者; 对于投资者通过其他销售机构认购/申购的 C 类基金份额, 持续持有超过一年计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者。

(4) 销售服务费用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务。

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、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险及其他风险等。本基金特有风险如下:

(1) 本基金为混合型基金, 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行或上市的股票(包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、政府支持债券、政府支持机构

债券、地方政府债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、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相关规定)。

本基金管理人将发挥专业研究优势,加强对各资产类别的深入研究,持续优化组合配置,以控制特定风险。

(2) 最短持有期届满前不能赎回基金份额的风险

每份基金份额的最短持有期为 6 个月,相应基金份额在最短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最短持有期内不能赎回及转换转出基金份额的风险。

(3) 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时,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,港股通标的股票不能及时卖出,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以及新增港股通交易日才为港股通交易日;香港出现联交所规定的情形时,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。

(4) 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。

（5）投资国债期货的特定风险

本基金的投资范围包括国债期货，国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

（6）投资科创板的特定风险

基金资产如投资科创板股票，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：

1）退市风险

a) 科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；

b) 退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；

c) 执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市；

d) 不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，上市公司退市风险更大。

2）市场风险

科创板企业相对集中于新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术产业和战略新兴产业，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，股票投资市场风险加大。

科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%，科创板股票上市首日即可作为融资融券标的，可能导致较大的股票价格波动。

3）流动性风险

科创板投资门槛较高，科创板的投资者可能以机构投资者为主，整体流动性可能相对较弱。此外，科创板股票网下发行时，获配账户存在被随机抽中设置一定期限限售期的可能，基金存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

4）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，所以科创板股票相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

5）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股票也会带来政策影响。

（7）投资存托凭证的特定风险

本基金可投资于存托凭证，会面临与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等差异带来的特有风险，包括但不限于创新企业业务持续能力和盈利能力等经营风险，存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托凭证退市的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及受境外市场影响交易价格大幅波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险等。本基金可投资存托凭证，基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

(8) 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。

(9) 本基金参与债券回购的风险

本基金可参与债券回购，债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对基金组合收益进行放大的同时，也对基金组合的波动性（标准差）进行了放大，即基金组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

(10) 发起式基金的特有风险

《基金合同》生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，本基金应当按照基金合同约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续。若届时有效的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。基金份额持有人面临基金合同可能终止的不确定性风险。

(11) 销售服务费计提与返还机制的相关风险

1) 本基金 C 类基金份额的销售服务费按日计提，但对于投资人通过直销机构认购/申购的 C 类基金份额计提的销售服务费，或者通过其他销售机构认购/申购且持续持有期限超过一年（即 365 天）的 C 类基金份额继续计提的销售服务费，都将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者（详见基金合同“基金费用与税收”章节），因此，C 类基金份额的销售服务费率水平需结合投资者的购买渠道以及 C 类基金份额持有期限确定。

2) 由于本基金在计算 C 类基金份额净值时，已按基金合同约定或另行公告的销售服务费年费率计提销售服务费，该计提金额可能高于投资者最终实际承担的销售服务费。在 C 类基金份额赎回或基金合同终止的情形发生时，基金投资者实际收到的赎回款项或清算款项的金额可能与披露的 C 类基金份额净值计算的结果存在差异。投资者的实际赎回金额和清算资金以登记机构确认数据为准。

(12) 基金合同提前终止风险

《基金合同》生效满三年后继续存续的，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终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会。基金份额持有人可能面临基金合同提前终止的不确定性风险。

(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