

东吴裕丰 6 个月持有期债券型集合资产管理计划(C 类份额)产品资料概要(更新)

编制日期：2024 年 1 月 16 日

送出日期：2024 年 1 月 16 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 | 东吴裕丰 6 个月持有债券 | 基金代码 | 970117 |
| 下属基金简称 | 东吴裕丰 6 个月持有债券 C | 下属基金交易代码 | 970118 |
| 基金管理人 | 东吴证券股份有限公司 | 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 12 月 27 日 | 上市交易所及上市日期 | - |
| 基金类型 | 债券型 | 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，本集合计划 C 类份额设定 6 个月最短持有期，最短持有期满后 方可办理赎回业务。 |
| 基金经理 | 江逸舟 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021 年 12 月 27 日 |
| | | 证券从业日期 | 2021 年 11 月 02 日 |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

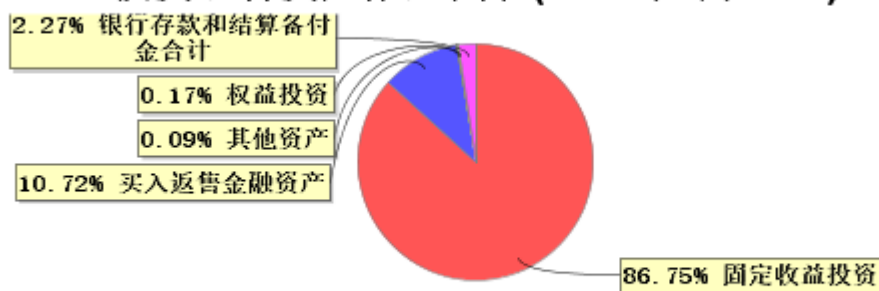
详见《东吴裕丰 6 个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》第九部分“集合计划的投资”。

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本集合计划主要投资于债券等固定收益类资产，在严格控制投资组合风险的前提下，力争实现资产的长期稳定增值。 |
| 投资范围 | <p>本集合计划的投资范围主要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（含存托凭证）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、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）、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <p>本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%，投资于股票（含存托凭证）资产的比例不高于集合计划资产的 20%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 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。</p> <p>如法律法规或监管机构允许集合计划投资其他品种或变更投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以相应调整上述集合计划的投资范围和投资比例规定。</p> |

| | |
|--------|---|
| 主要投资策略 | 1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、股票投资策略；4、国债期货投资策略；5、资产支持证券投资策略 |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10% |
| 风险收益特征 | 本集合计划为债券型集合计划，其风险收益水平低于混合型基金、混合型集合计划、股票型基金和股票型集合计划，高于货币型基金和货币型集合计划。 |

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

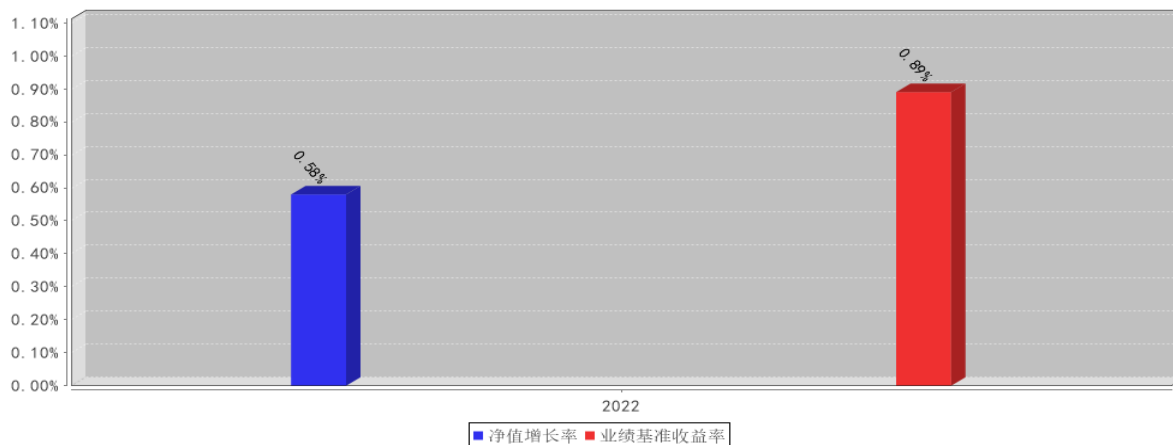
投资组合资产配置图表(2023年9月30日)



● 固定收益投资 ● 买入返售金融资产 ● 其他资产 ● 权益投资
● 银行存款和结算备付金合计

(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

东吴裕丰6个月持有债券C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图（2022年12月31日）



三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

申购费

对于申购本集合计划 C 类份额的投资人，申购费率为零。如果投资人多次申购本集合计划 C 类份额，则其持有的 C 类份额赎回开放时间可能不同。

赎回费

本集合计划无赎回费用。

(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 | |
|-------|---|-------|
| 管理费 | 固定费率 | 0.5% |
| 托管费 | 固定费率 | 0.15% |
| 销售服务费 | 固定费率 | 0.35% |
| 其他费用 | 《资产管理合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费；集合计划份额持有人大会费用；集合计划的证券/期货交易费用；集合计划的银行汇划费用；集合计划相关账户的开户及维护费用；按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。 | |

注：本集合计划交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从集合计划资产扣除。

四、风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本集合计划不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买本集合计划时应认真阅读本集合计划的《招募说明书》等销售文件。

本集合计划面临的主要风险包括但不限于：市场风险，管理风险，流动性风险、启用侧袋机制风险等。

本集合计划为债券型集合资产管理计划，投资范围包括股票、债券、国债期货、资产支持证券等，存在相应的投资风险。

本集合计划 A 类份额和 C 类份额均设定 6 个月最短持有期，最短持有期满后后方可办理赎回业务，对投资者存在流动性风险，投资者要考虑在最短持有期满前不能赎回的风险。

《资产管理合同》生效后，连续 20 个工作日出现份额持有人数量不满 200 人或者集合计划资产净值低于 5000 万元情形的，投资者可能面临集合计划因上述原因转换运作方式、与其他公开募集性质的集合资产管理计划合并或者终止《资产管理合同》的风险。

(二) 重要提示

中国证监会对本集合计划募集的批准，并不表明其对本集合计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险。

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集合计划财产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

投资者自依《资产管理合同》取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和《资产管理合同》的当事人。

投资者实际赎回金额，以登记机构确认数据为准。

集合计划产品资料概要信息发生重大变更的，管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比集合计划的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取集合计划的相关信息，敬请同时关注管理人发布的相关临时公告等。

因《资产管理合同》而产生的或与《资产管理合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议向集合计划被告住所地有管辖权的法院提起诉讼。

五、其他资料查询方式

以下资料详见管理人网站[www.dwzq.com.cn][客服电话：95330]

- 1、资产管理合同、托管协议、招募说明书
- 2、定期报告，包括集合计划季度报告、中期报告和年度报告
- 3、集合计划份额净值

4、集合计划销售机构及联系方式

5、其他重要资料

六、其他情况说明

-