

东吴兴享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：2024年6月19日

送出日期：2024年6月20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	东吴兴享成长混合	基金代码	010330
下属基金简称	东吴兴享成长混合A		东吴兴享成长混合C
下属基金代码	010330		011462
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	2020-11-11	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	刘瑞	开始担任本基金基金经理的日期	2023-12-25
		证券从业日期	2013-03-04
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，在基金管理人履行适当程序后，本基金合同自动终止，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。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		

注：东吴兴享成长混合型证券投资基金自2021年2月10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》第九章了解详细情况

投资目标	本基金重点关注企业的成长性，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（包括中小板、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、公开发行的次级债等）、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的其他品种，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30%）；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

本基金将通过深入研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对各类资产风险收益特征进行深入分析，评估股票、债券等大类资产的估值水平和投资价值，确定投资组合的资产配置比例，并适时进行动态调整，以期达到风险和收益的优化平衡。

（二）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，根据宏观经济运行特征、经济景气周期以及行业周期轮动特征，从经济周期因素、行业发展政策因素、产业结构变化趋势因素以及行业自身景气周期因素等多个维度把握不同行业的景气度变化情况和趋势，精选符合盈利趋势向好、发展前景良好、具有良好投资价值的行业进行重点配置。

2、个股选择策略

本基金通过定量和定性相结合的方法进行自下而上的个股选择，对企业的成长空间及基本面进行综合的研判，精选具有较高成长预期的优质成长型上市公司。

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。

（三）债券投资策略

本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。

（四）资产支持证券投资策略

本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用数量化定价模型，评估其内在价值。

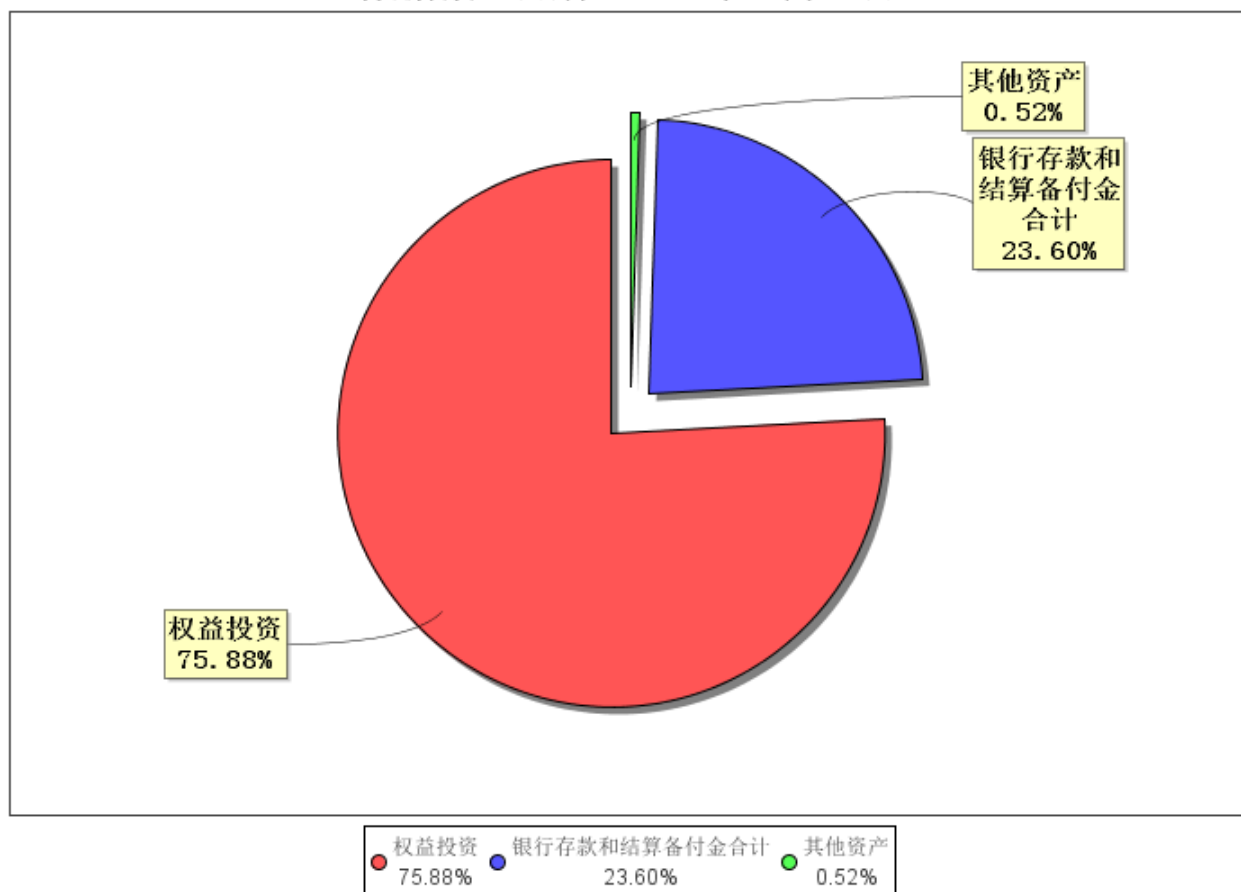
（五）股指期货投资策略

本基金将以股指期货为主的金融衍生工具与资产配置策略进行搭配，以套期保值为主要目的，并利用股指期货灵活快速进出的优势，控制仓位风险，同时可以降低交易成本，为实际的投资操作提供多一项选择。

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。

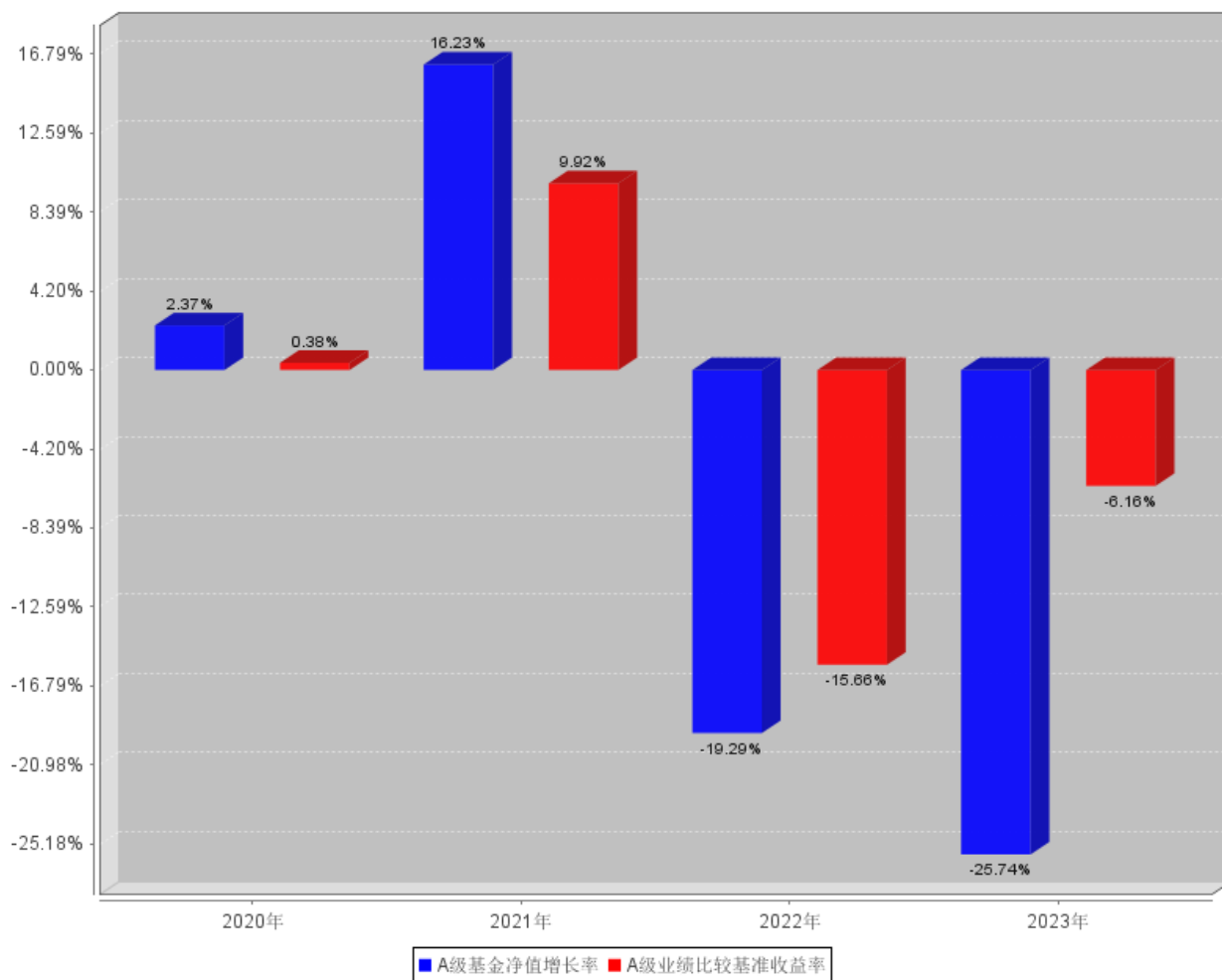
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表
数据截止日期：2023年12月31日

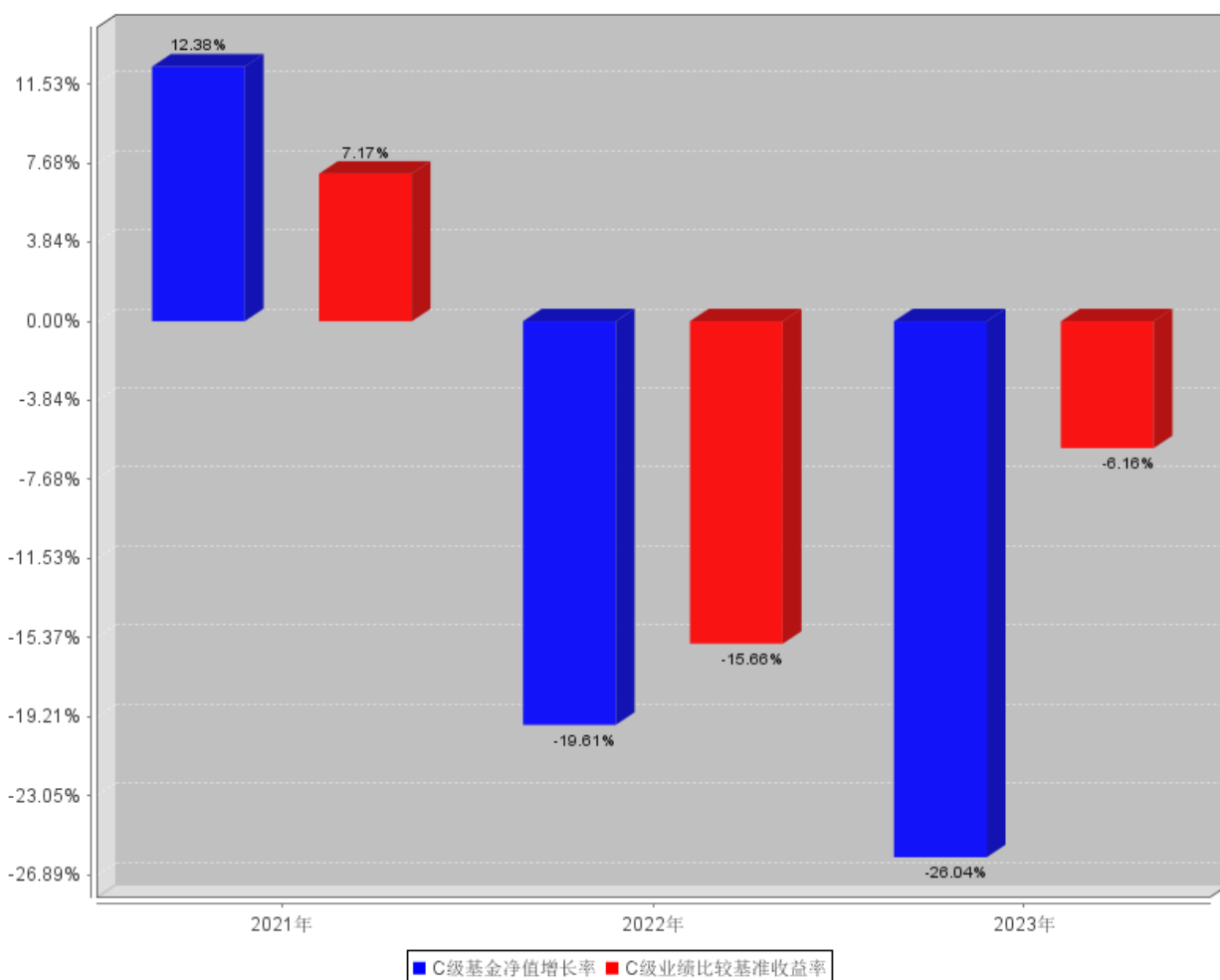


(三) 自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

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2023年12月31日。基金过往业绩不代表未来表现。
- 2、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%。
- 3、本基金于2021年2月10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：

东吴兴享成长混合 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
申购费（前收费）	M<1,000,000	1.5%	-
	1,000,000≤M<2,000,000	1.0%	-
	2,000,000≤M<5,000,000	0.6%	-
	M≥5,000,000	1000元/笔	-
赎回费	N<7日	1.50%	-
	7日≤N<30日	0.75%	-
	30日≤N<180日	0.50%	-
	N≥180日	0%	-

东吴兴享成长混合 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≤N<30日	0.50%	-
	N≥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/年费率或金额	收取方
管理费	年费率1.2%	基金管理人和销售机构
托管费	年费率0.2%	基金托管人
销售服务费	东吴兴享成长混合A - 东吴兴享成长混合C 年费率0.4%	销售机构
审计费用	年费用金额55000.00元	会计师事务所
信息披露费	年费用金额120000.00元	规定披露报刊
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。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

东吴兴享成长混合 A

基金运作综合费率（年化）	
-	1.43%

东吴兴享成长混合 C

基金运作综合费率（年化）	
-	1.83%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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。投资者可能损失投资本金。

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

本基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“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将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，在基金管理人履行适当程序后，基金合同自动终止，不需召开基金份额持有人大会。

（5）投资科创板股票存在的风险

1) 退市风险

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；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；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；且不再设置暂停上市、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幅限制，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。

3) 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。

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

-