东吴行业轮动混合型证券投资基金基金产品资料概要

编制日期：2020年8月26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。

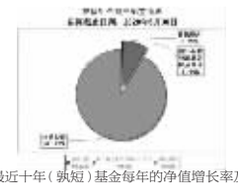
一、产品概况

基金简称	东吴行业轮动混合	基金代码	580003
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	开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	邹炜	开始担任本基金基金经理的日期	2020-08-04
		证券从业日期	2010-07-15
其他			

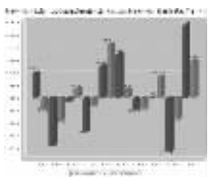
二、基金投资与净值表现
（一）投资目标与投资策略
请投资者阅读《招募说明书》第十章了解详细情况

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	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。 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。
主要投资策略	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。 1、行业配置策略 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。 2、选股策略 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。 3、债券投资策略 4、权证投资策略
业绩比较基准	75%*沪深300指数+25%*中证全债指数
风险收益特征	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市场基金和债券型基金，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。

（二）投资组合资产配置图表



（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



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：

费用类型	金额（M）/持有期限（N）	收费方式/费率	备注
申购费（前收费）	M＜100万	1.50%	
	100万≤M＜200万	1.20%	
	200万≤M＜500万	0.80%	
	M≥500万	1000元/笔	
赎回费	N＜7天	1.50%	
	7天≤N≤1年	0.50%	
	1年＜N≤2年	0.25%	
	N＞2年	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	1.50%
托管费	0.25%
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、职业道德风险、流动性风险、估值风险、合规性风险及其他风险等。本基金特有风险如下：
（1）指数投资风险
1）标的指数的风险：即标的指数因为编制方法的缺陷有可能导致标的指数的表现与总体市场表现的差异，因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大，增加基金投资成本，并有可能因此而增加跟踪误差，影响投资收益。
2）标的指数波动的风险：标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。
3）跟踪偏离风险：即基金在跟踪指数时由于各种原因导致基金的业绩表现与标的指数表现之间产生差异的不确定性，可能包括：
①基金在跟踪指数过程中由于买入和卖出债券时均存在交易成本，导致本基金在跟踪指数时可能产生收益上的偏离；
②受市场流动性风险的影响，本基金在实际管理过程中，由于投资者申购而增加的资金可能不能及时地转化为标的指数的成份债、或在面临投资者赎回时无法以赎回价格将债券及时地转化为现金，这些情况使得本基金在跟踪指数时存在一定的跟踪偏离风险；
③在本基金实行指数化投资过程中，基金管理人对指数基金的管理能力例如跟踪指数的技术手段、买入卖出的时机选择等都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。
（2）投资资产支持证券的风险
资产支持证券的投资风险主要包括流动性风险、利率风险及评级风险等。由于资产支持证券的投资收益来自于基础资产产生的现金流或剩余权益，因此资产支持证券投资还面临基础资产特定原始权益人的破产风险及现金流预测风险等与基础资产相关的风险。
（3）投资中小企业私募债的风险
本基金投资中小企业私募债券，中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。
（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。
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

东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要

编制日期：2020年8月26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

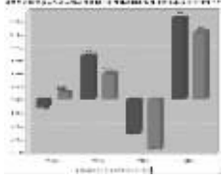
基金简称	东吴安鑫量化混合	基金代码	002561
基金管理人	东吴基金管理有限公司	基金托管人	江苏银行股份有限公司
基金合同生效日	2016-06-03	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	周健	开始担任本基金基金经理的日期	2020-07-23
		证券从业日期	2006-08-01
其他			

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	本基金采用量化策略进行选股和择时，控制风险，追求持续的资产增值。
投资范围	本基金投资于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、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具，以及债券等固定收益类金融工具（包括但不限于国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等）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：本基金股票投资占基金资产的0%-95%，投资于债券等固定收益类资产比例不低于基金资产的5%，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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的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、应收申购款等。
主要投资策略	本基金采用以股票投资为主，固定收益类资产管理为辅的投资策略。本基金一方面引入量化择时策略，进行股票组合投资的建仓、平仓和止盈止损，另一方面通过多因子量化模型选择优势股票组合，以期为投资者带来稳定收益。 （一）择时策略 本基金通过对中证800指数样本股从市场广度分析、成交量分析和动量分析三个维度进行趋势的量化跟踪分析，以此确定交易时机。根据均线系统策略、相对强弱模型等形成具客观性、一致性的量化交易规则，严格执行开平仓、止盈止损、平仓后再入场等操作。 （二）组合配置策略 1、行业组合 利用择时策略确定操作时点后，采用多因子模型优选技术和基本面因子排名居前的子行业（参照申万二级行业划分标准）进行配置。 2、替代成份股 （三）资产支持证券投资策略 （四）股指期货投资策略 （五）权证投资策略 （六）固定收益类资产投资策略
业绩比较基准	65%×中证800指数收益率+35%×中国债券综合全价（总值）指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

（二）投资组合资产配置图表

（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



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：

费用类型	金额（M）/持有期限（N）	收费方式/费率	备注
申购费（前收费）	M＜100万	1.50%	
	100万≤M＜200万	1.20%	
	200万≤M＜500万	0.80%	
	500万≤M＜1000万	0.30%	
	M≥1000万	1000元/笔	
赎回费	N＜7天	1.50%	
	7天≤N＜30天	0.75%	
	30天≤N＜1年	0.50%	
	1年≤N＜2年	0.25%	
	N≥2年	0.00%	

（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	0.80%
托管费	0.25%
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、估值风险、合规性风险及其他风险等。本基金特有风险如下：
1、本基金投资于货币市场工具，基金收益受货币市场流动性及货币市场利率波动的影响较大，一方面，货币市场利率的波动影响基金的再投资收益，另一方面，在为应付基金赎回而卖出证券的情况下，证券交易量不足可能使基金面临流动性风险，而货币市场利率的波动也会影响证券公允价值的变动及其交易价格的波动，从而影响基金的收益水平。因此，本基金可能面临较高流动性风险以及货币市场利率波动的系统性风险。
（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。
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

东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要

编制日期：2020年8月26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。

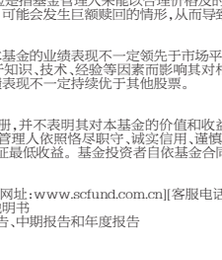
一、产品概况

基金简称	东吴国企改革混合	基金代码	002159
基金管理人	东吴基金管理有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日	2015-12-30	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	开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	周健	开始担任的基金基金经理的日期	2019-05-30
		证券从业日期	2006-08-01
其他			

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	本基金为混合型基金，通过灵活的资产配置，重点投资于在国内上市的国企改革主题的上市公司，在科学严格管理风险的前提下，力争为投资人提供长期稳定的投资回报。
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（含中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、中小企业私募债、短期融资券、公司债、中期票据、次级债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、银行存款、因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证、因投资可分离债券而产生的权证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）。 本基金不直接从二级市场买入股票、权证等资产，也不参与一级市场新股或增发新股的申购。因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证、因投资可分离债券而产生的权证，须在达到可交易状态日起10个交易日内卖出。 本基金的投资组合比例为：投资于中证可转换债券指数的成份券及其备选成份券的比例不低于基金资产净值的90%；现金或者到期日在一年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；其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。
主要投资策略	本基金为债券指数基金，对指数投资部分，采用优化复制标的指数的投资策略，主要以标的指数的成份券及其备选成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性等情况，对投资组合进行优化调整，以保证对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 1、资产配置策略 2、指数投资策略 对指数投资部分，采用优化复制标的指数法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性等情况，对投资组合进行优化调整，以保证对标的指数的有效跟踪。 3、中小企业私募债券投资策略 4、资产支持证券投资策略
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×95%＋银行税后活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金是债券型指数基金，长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

（二）投资组合资产配置图表
（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



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：

费用类型	金额（M）/持有期限（N）	收费方式/费率	备注
申购费（前收费）	M＜10万	0.50%	
	10万≤M＜100万	0.40%	
	100万≤M＜200万	0.20%	
	M≥200万	1000元/笔	
赎回费	N＜7日	1.50%	
	7日≤N＜3个月	0.50%	
	3个月≤N（1年	0.30%	
	1年≤N＜2年	0.05%	
	N≥2年	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	0.40%
托管费	0.10%
其他费用	1.标的指数使用许可费0.015%/年费率； 2.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、职业道德风险、流动性风险、估值风险、合规性风险及其他风险等。本基金特有风险如下：
（1）指数投资风险
1）标的指数的风险：即标的指数因为编制方法的缺陷有可能导致标的指数的表现与总体市场表现的差异，因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大，增加基金投资成本，并有可能因此而增加跟踪误差，影响投资收益。
2）标的指数波动的风险：标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。
3）跟踪偏离风险：即基金在跟踪指数时由于各种原因导致基金的业绩表现与标的指数表现之间产生差异的不确定性，可能包括：
①基金在跟踪指数过程中由于买入和卖出债券时均存在交易成本，导致本基金在跟踪指数时可能产生收益上的偏离；
②受市场流动性风险的影响，本基金在实际管理过程中，由于投资者申购而增加的资金可能不能及时地转化为标的指数的成份债、或在面临投资者赎回时无法以赎回价格将债券及时地转化为现金，这些情况使得本基金在跟踪指数时存在一定的跟踪偏离风险；
③在本基金实行指数化投资过程中，基金管理人对指数基金的管理能力例如跟踪指数的技术手段、买入卖出的时机选择等都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。
（2）投资资产支持证券的风险
资产支持证券的投资风险主要包括流动性风险、利率风险及评级风险等。由于资产支持证券的投资收益来自于基础资产产生的现金流或剩余权益，因此资产支持证券投资还面临基础资产特定原始权益人的破产风险及现金流预测风险等与基础资产相关的风险。
（3）投资中小企业私募债的风险
本基金投资中小企业私募债券，中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。
（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。
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

东吴货币市场证券投资基金基金产品资料概要

编制日期：2020年8月26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。

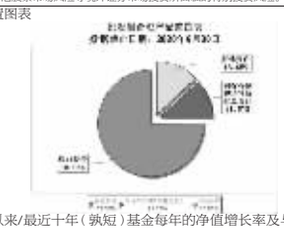
一、产品概况

基金简称	东吴货币	基金代码	东吴货币A：583001
			东吴货币B：583101
基金管理人	东吴基金管理有限公司	基金托管人	中国农业银行股份有限公司
基金合同生效日	2010-05-11	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	货币市场基金	交易币种	人民币
运作方式	开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	邵笛	开始担任本基金基金经理的日期	2014-10-30
		证券从业日期	2006-10-01
	王文华	开始担任本基金基金经理的日期	2018-04-11
		证券从业日期	2006-03-01
其他			

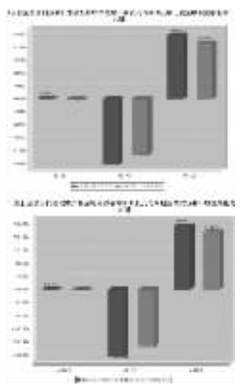
二、基金投资与净值表现
（一）投资目标与投资策略
请投资者阅读《招募说明书》第十章了解详细情况

投资目标	在控制风险和保证流动性的前提下，通过主动式管理及量化分析，为投资者提供稳定的收益。
投资范围	本基金投资于法律法规允许投资的金融工具，具体如下： 现金，期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在397天以内（含397天）的债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具，以及法律法规或中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。 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。
主要投资策略	本基金采取积极的投资策略，自上而下地进行投资管理。通过定性分析和定量分析，形成对短期利率变化方向的预测；在此基础之上，确定组合久期和类别资产配置比例；在此框架之下，通过把握收益率曲线形变和无风险套利机会来进行品种选择。 在资产配置策略方面，本基金的资产配置策略包括1、类别资产配置策略；2、类属资产配置策略；3、品种选择方法。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，在所有证券投资基金中，是风险相对较低的基金产品。在一般情况下，其风险与预期收益均低于一般债券基金，也低于混合型基金与股票型基金。

（二）投资组合资产配置图表



（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



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：

费用类型	金额（M）/持有期限（N）	收费方式/费率	备注
A类份额申购费（前收费）	M＜50万	1.50%	
	50万≤M＜300万	0.75%	
	300万≤M＜500万	0.50%	
	M≥500万	1000元/笔	
A类份额赎回费	N＜7天	1.50%	
	7天≤N＜30天	0.75%	
	30天≤N＜180天	0.50%	
	N≥180天	0%	
C类份额赎回费	N＜7天	1.50%	
	7天≤N＜30天	0.50%	
	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/费率
管理费	1.50%
托管费	0.25%
销售服务费（C类）	0.50%
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、交易对手违约风险、投资港股通标的股票的风险及其他风险等。本基金特有风险如下：
1、本基金投资范围包括股指期货、国债期货等金融衍生品，金融衍生品投资可能给本基金带来额外风险，包括杠杆风险、期货价格与基金投资品种价格的相关度降低带来的风险等，由此可能增加本基金净值的波动性。
2、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。
（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。
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

东吴基金管理有限公司旗下全部基金2020年中期报告提示性公告

本公司董事会及董事保证基金年度报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
东吴基金管理有限公司旗下，东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金、东吴价值成长双动力混合型证券投资基金、东吴行业轮动混合型证券投资基金、东吴优信稳健债券型证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、东吴新经济混合型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、东吴增利债券型证券投资基金、东吴新产业精选混合型证券投资基金、东吴沪深300指数型证券投资基金、东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金、东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金、东吴鼎利债券型证券投资基金(LOF)、东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金、东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金、东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金、东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金、东吴鼎元双债债券型证券投资基金、东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金、东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金、东吴增鑫宝货币市场基金、东吴优益债券型证券投资基金、东吴双三角股票型证券投资基金、东吴悦秀纯债债券型证券投资基金、东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金的2020年中期报告全文于2020年8月29日在本公司网站（http://www.scfund.com.cn）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）披露，供投资者查阅。如有疑问可拨打本公司客服电话（400-821-0588）咨询。
本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。请充分了解基金的风险收益特征，审慎做出投资决定。
特此公告。

东吴基金管理有限公司
2020年8月29日

本基金参与股指期货交易。股指期货交易采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股指期货标的指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。此外，交易所对股指期货的交易限制与规定会对基金投资股指期货的策略执行产生影响，从而对基金收益产生不利影响。
（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。
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

东吴中证可转换债券指数证券投资基金基金产品资料概要

编制日期：2020年8月26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

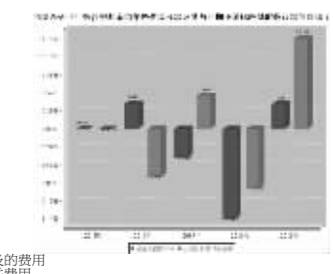
基金简称	东吴中证可转债指数	基金代码	165809
基金管理人	东吴基金管理有限公司	基金托管人	平安银行股份有限公司
基金合同生效日	2020-08-12	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	王文华	开始担任本基金基金经理的日期	2020-08-12
		证券从业日期	2006-03-01
其他	东吴中证可转换债券指数证券投资基金由东吴中证可转换债券指数分级证券投资基金转型而来。		

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》第十二章了解详细情况

投资目标	本基金为债券型指数证券投资基金，采用优化复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。本基金按照成份券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调整，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪误差的最小化。
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，包括标的指数的成份券及其备选成份券、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、可转债（含分离交易可转债）、地方政府债、政府机构债、债券回购、同业存单、货币市场工具、银行存款、因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证、因投资可分离债券而产生的权证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。 本基金不直接从二级市场买入股票、权证等资产，也不参与一级市场新股或增发新股的申购。因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证、因投资可分离债券而产生的权证，须在达到可交易状态日起10个交易日内卖出。 本基金的投资组合比例为：投资于中证可转换债券指数的成份券及其备选成份券的比例不低于基金资产净值的90%；现金或者到期日在一年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；其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定执行。
主要投资策略	本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势，采取兼顾风险预算管理的多层次复合投资策略，科学严谨规范资产配置以求基金资产的长期稳定增长。 （一）大类资产配置策略 （二）股票精选策略 本基金的股票投资以深入的基本面研究为基础，从定性定量两个方面，精选国企改革主题上市公司中基本面良好、具有发展前景的优质上市公司进行投资，构建投资组合。 1、国企改革主题上市公司的界定 本基金所指国企改革包括国资监管体制改革、产权制度改革(如兼并重组、整合上市、混合所有制改革等)以及国企管理制度改革(如经营机制、薪酬机制改革等)等多种方式，国企改革主题上市公司界定为： 1）已实施改革方案或具有改革预期的国有上市公司； 2）因国企改革，而在行业准入门槛降低、国资布局调整、国资退出等相关主题受益的非国有上市公司。 未来若出现其他受益于国企改革进程的上市公司，本基金也应在深入研究的基础上，本着审慎的原则将其列入备选股票池。本基金将在备选股票池的基础上，以定性和定量相结合的方式，从价值和成长等因素对个股进行选择，精选估值合理且成长性好的上市公司进行投资。 2、个股精选 （三）债券投资策略；（四）中小企业私募债投资策略；(五)资产支持证券投资策略；（六）股指期货投资策略；（七）权证投资策略
业绩比较基准	中证国有企业改革指数×50%+中债综合指数×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，预期风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

（二）投资组合资产配置图表

（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



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：

费用类型	金额（M）/持有期限（N）	收费方式/费率	备注
申购费（前收费）	M＜100万	1.50%	
	100万≤M＜200万	1.20%	
	200万≤M＜500万	0.80%	
	500万≤M＜1000万	0.30%	
	M≥1000万	1000元/笔	
赎回费	N＜7天	1.50%	
	7天≤N＜30天	0.75%	
	30天≤N＜1年	0.50%	
	1年≤N＜2年	0.25%	
	N≥2年	0.00%	

（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	1.50%
托管费	0.25%
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、估值风险、合规性风险及其他风险等。本基金特有风险如下：
（1）指数投资风险
1）标的指数的风险：即标的指数因为编制方法的缺陷有可能导致标的指数的表现与总体市场表现的差异，因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大，增加基金投资成本，并有可能因此而增加跟踪误差，影响投资收益。
2）标的指数波动的风险：标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投