

# 东吴中证新兴产业指数证券投资基金 基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021年3月30日

送出日期：2021年3月31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	东吴中证新兴指数	基金代码	585001
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	2011-02-01	上市交易所及上市日期	暂未上市
基金类型	股票型	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	2020-01-18
		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	本基金采用指数化投资，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%，以实现对标指数的有效跟踪。
投资范围	本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股、备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中，中证新兴产业指数成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产的90%，现金及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。 因基金规模或市场变化等因素导致本基金投资组合不符合上述规定的，基金管理人将在10个工作日内调整至符合上述规定。法律、法规另有规定的，从其规定。
主要投资策略	1、股票投资组合的构建 本基金对中证新兴产业指数进行完全复制，在初始建仓期或者为申购资金建仓时，本基金按照中证新兴产业指数各成份股所占权重逐步买入。在买入过程中，本基金采取相应的交易策略降低建仓成本，力求跟踪误差最小化。在投资运作过程中，本基金以标的指数权重为标准配置个股，并进行适时调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭

配使用其他合理方法进行适当的替代。

#### 2、股票投资组合的调整

本基金为完全复制的指数型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、配股增发因素等变化，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。

#### 3、替代成份股的构建

本基金选择其他中证新兴产业指数成份股或备选成份股构建替代成份股。

#### 4、基金组合的优化策略

本基金对由于仓位限制、基金费用、成份股调整、申购赎回等因素产生的跟踪误差，采取适当策略进行修正。

#### 5、跟踪误差控制

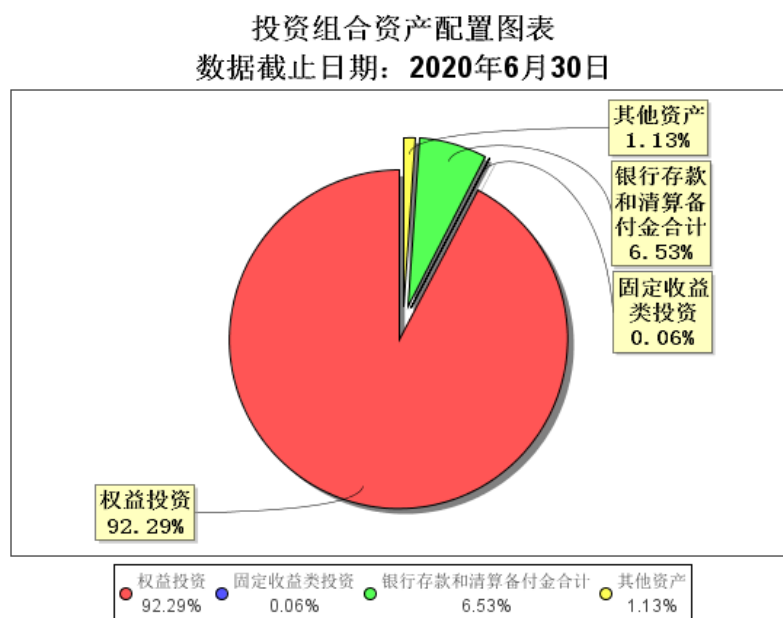
本基金定期计算基金组合的跟踪误差和跟踪偏离度，确保单日基金跟踪偏离度不高于 0.35%，年度跟踪误差不超过 4%。特殊情况下，本基金通过定性研究和定量分析方法，对基金资产组合进行适当调整，以期在约定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

**业绩比较基准** 95%\*中证新兴产业指数收益率+5%\*银行同业存款利率

#### 风险收益特征

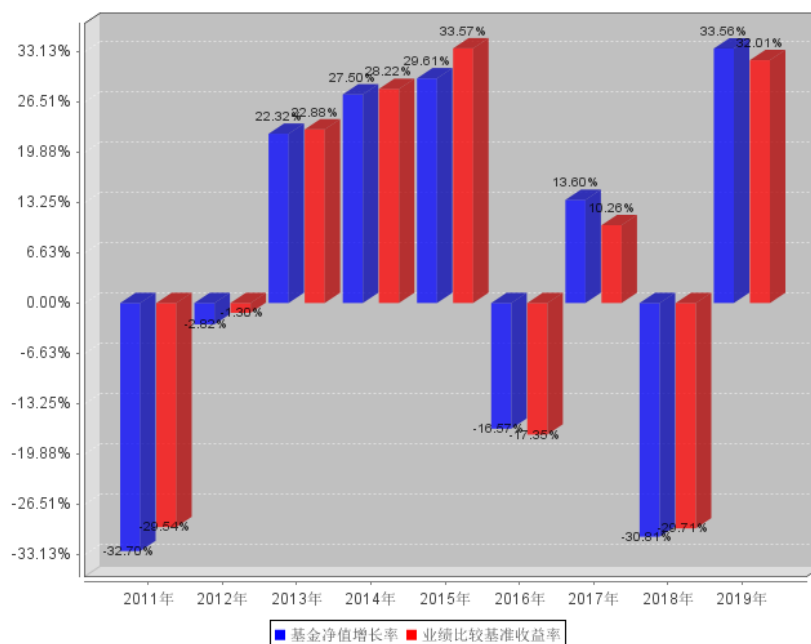
本基金属于股票型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金以及混合型基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪中证新兴产业指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益也较高的品种。

### (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

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



### 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	1.20%	
	100 万 ≤ M < 200 万	0.80%	
	200 万 ≤ M < 500 万	0.40%	
	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	1.00%
托管费	0.15%
其他费用	1、基金的指数使用费； 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、流动性风险、策略风险及其他风险等。本基金特有风险如下：

作为一只指数型基金，本基金具有一些与主动管理型基金不同的风险，主要体现在以下两方面：

### 1、指数下跌风险

指数下跌风险指由于本基金紧密跟踪指数，当市场下跌时，由于本基金跟踪指数而对基金净值造成损失的不确定性。

### 2、标的指数风险

标的指数风险可能有以下几种情况：

#### （1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

#### （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、投资人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）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

1) 由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

2) 由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

3) 成份股派发现金红利、新股收益将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生跟踪误差。

4) 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

5) 由于基金应对日常赎回保留的少量现金、投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费等存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度和跟踪误差。

6) 在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、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。

7) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；如未来法律法规允许的情况下的卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪误差；因基金申购与赎回带来的现金变动等；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

#### （4）指数编制方案变更风险

标的指数的编制方案存在变更的可能，从而引发标的指数成份股及权重发生较大调整，进而增加基金投资成本和跟踪误差，对基金净值表现产生影响。

#### （5）标的指数成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

1) 基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

2) 若成份股停牌时间较长，在约定时间内仍未能及时买入或卖出的，由此可能影响投资者的投资

损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

3)在极端情况下,标的指数成份股可能大面积停牌,基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回款项,由此基金管理人可能采取暂停赎回的措施,投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

#### (6)跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%,但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围,本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

#### (7)指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护,未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护,本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决,基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的,基金合同终止。投资人可能面临更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前,基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作,该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异,影响投资收益。

#### (8)标的指数值计算出错的风险

尽管指数编制机构将采取必要措施以确保指数的准确性,但不对此作任何保证,亦不因指数的任何错误对任何人负责。因此,如果标的指数值出现错误,投资人参考指数值进行投资决策,则可能导致损失。

### (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。

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