

东吴阿尔法灵活配置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24日

送出日期：2024年6月25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	东吴阿尔法混合	基金代码	000531
下属基金简称	东吴阿尔法混合A		东吴阿尔法混合C
下属基金代码	000531		014581
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	中国农业银行股份有限公司
基金合同生效日	2014-03-19	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	徐慢	开始担任本基金基金经理的日期	2024-06-21
		证券从业日期	2019-09-23

注：东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金自2021年12月23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	本基金为混合型基金，坚持以大类资产轮动为主、金融衍生品对冲投资为辅的投资策略，在有效控制风险的前提下，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、债券、权证、货币市场工具、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：股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）投资比例不高于基金资产的95%；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、银行存款以及货币市场工具等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的5%；权证投资比例不高于基金资产净值的3%；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

1、资产配置策略

2、股票投资策略

本基金秉承价值型的投资理念，在个股精选的过程中将以寻找价值被低估的股票为基本原则，在分享股价合理回归的收益的同时力求达到投资组合较高的安全边际。

3、债券投资策略

4、股指期货投资策略

业绩比较基准

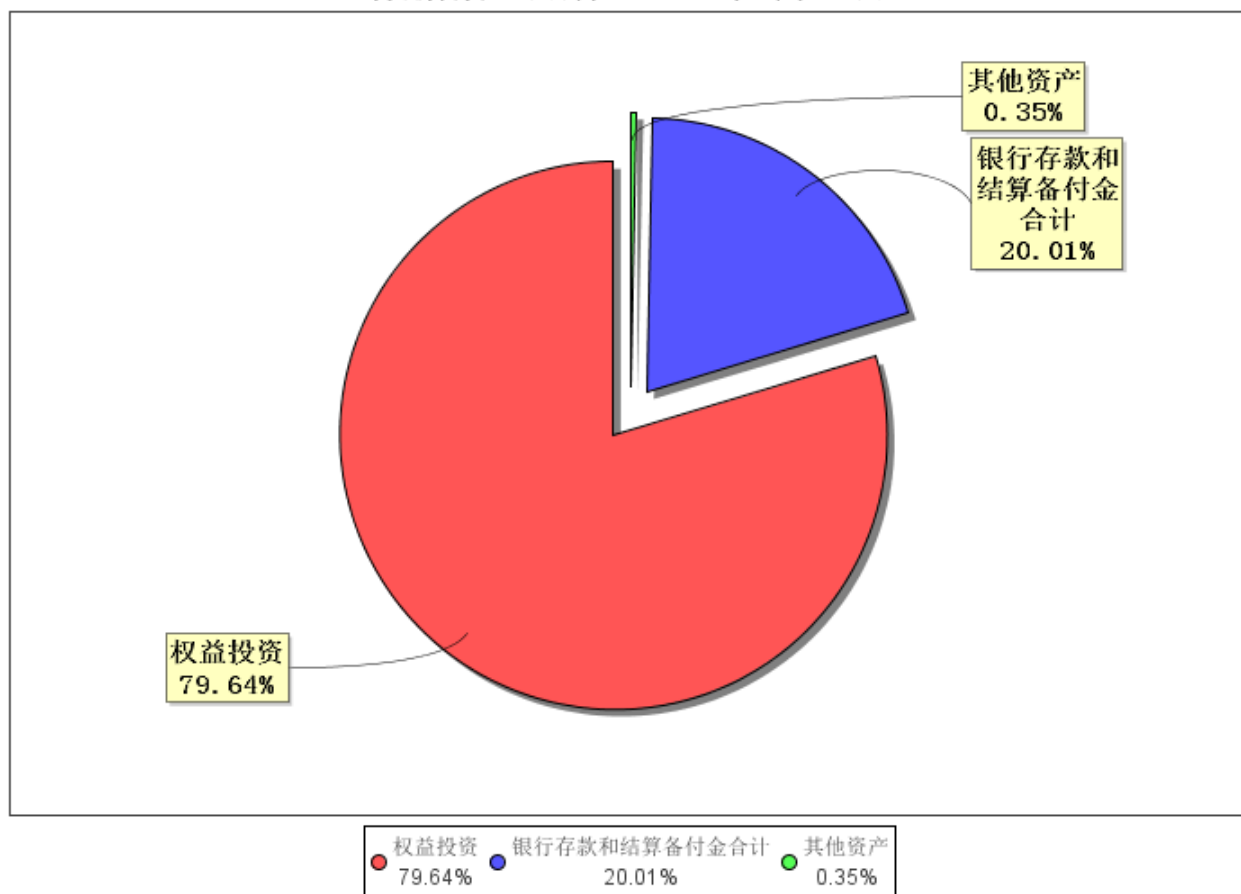
本基金业绩比较基准为：沪深300指数×65%+中国债券综合全价指数×35%。

风险收益特征

本基金是一只进行主动投资的混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，在证券投资基金中属于预期风险较高、预期收益也较高的基金产品。前款有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同。本基金的风险等级可能有相应变化，具体风险评级结果应以销售机构的评级结果为准。

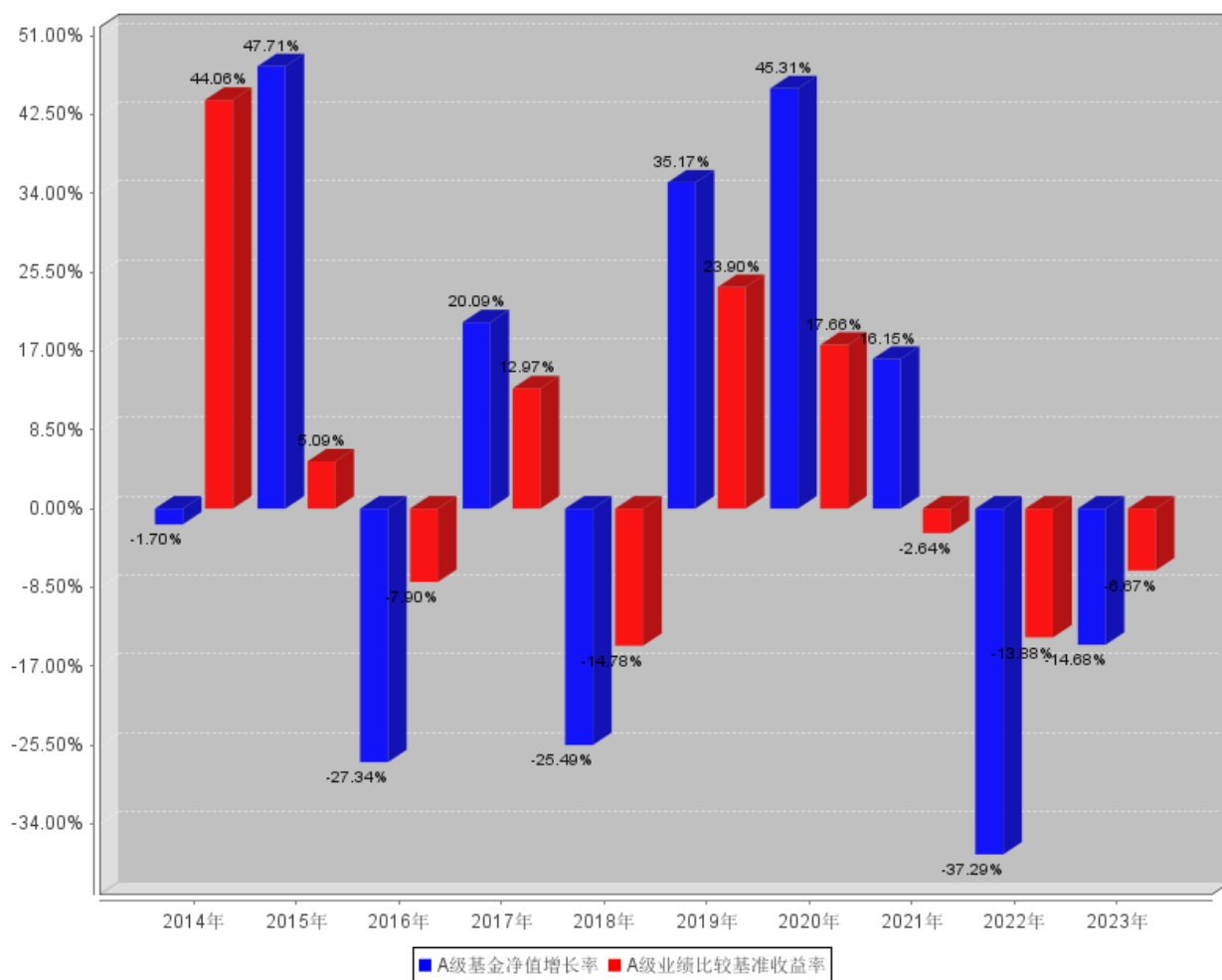
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表
数据截止日期：2024年3月31日

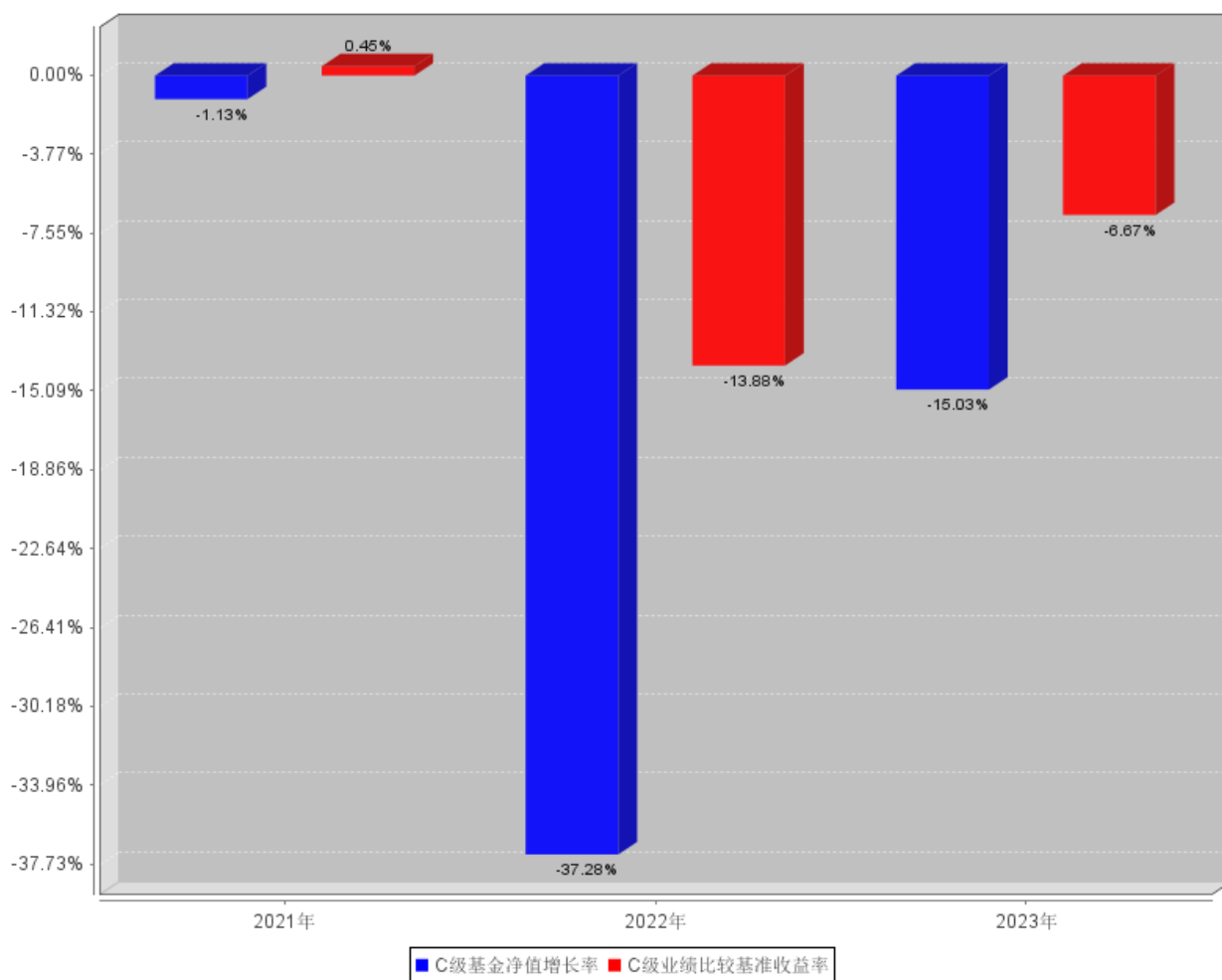


（三）自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

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



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。

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：

东吴阿尔法混合 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	1.50%	-
	1,000,000≤M<2,000,000	1.20%	-
	2,000,000≤M<5,000,000	0.80%	-
	5,000,000≤M<10,000,000	0.30%	-
	M≥10,000,000	1000元/笔	-
赎回费	N<7日	1.50%	-
	7日≤N<30日	0.75%	-
	30日≤N<365日	0.50%	-
	1年≤N<2年	0.25%	-
	N≥2年	0%	-

东吴阿尔法混合 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	东吴阿尔法混合A - 东吴阿尔法混合C 年费率0.4%	销售机构
审计费用	年费用金额26,500.00元	会计师事务所
信息披露费	年费用金额50,000.00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：

东吴阿尔法混合 A

基金运作综合费率（年化）
1.71%

东吴阿尔法混合 C

基金运作综合费率（年化）
2.11%

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。

1、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险。

2、管理风险

基金运作过程中由于基金投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或公司内部失控而可能产生的损失。

3、职业道德风险：是指公司员工不遵守职业操守，发生违法、违规行为而可能导致的损失。

4、流动性风险

本基金属于开放式基金，基金份额可以在基金合同约定的时间和场所进行申购和赎回，因此会面临一定的流动性风险。所谓流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。在基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形，从而导致基金仓位调整的困难，引发流动性风险，甚至影响基金份额净值。

5、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

6、投资管理风险：（1）本基金为混合型基金，其预期收益和风险均高于货币型基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的较高风险、较高收益的基金类型；（2）选股方法、选股模型风险；（3）基金经理主观判断错误的风险；（4）其他风险。

7、投资股指期货的风险

8、其他风险

（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