

# 东吴安享量化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：2021年9月10日

送出日期：2021年9月13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	东吴安享量化混合	基金代码	580007
基金管理人	东吴基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2017-02-22	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	徐增	开始担任本基金基金经理的日期	2020-12-16
		证券从业日期	2009-07-27
其他	东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金由东吴新创业混合型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》第八章了解详细情况

投资目标	本基金在充分控制风险的前提下，采用定量、定性相结合的策略进行资产配置，追求持续的资产增值。
投资范围	<p>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、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）。</p> <p>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。</p> <p>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%，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。</p>
主要投资策略	<ol style="list-style-type: none"><li>1、资产配置策略</li><li>2、选股策略<ol style="list-style-type: none"><li>（1）行业配置</li></ol></li></ol>

**(2) 个股精选**

本基金使用多因子模型进行个股优选，主要参考估值因子、成长因子、盈利因子、分红因子、反转因子等指标，前三类因子为长期有效因子，在模型中会保持较高比例，其余因子的权重要视市场环境进行分配。体现估值水平的因子包括但不限于历史PE、PB、预估PE等，体现成长性的因子包括但不限于净利润历史增长率、净利润预期增长率、主营收入增长率等，体现盈利水平的因子包括但不限于ROE、毛利率等。

3、资产支持证券投资策略

4、股指期货投资策略

5、权证投资策略

6、固定收益类资产投资策略

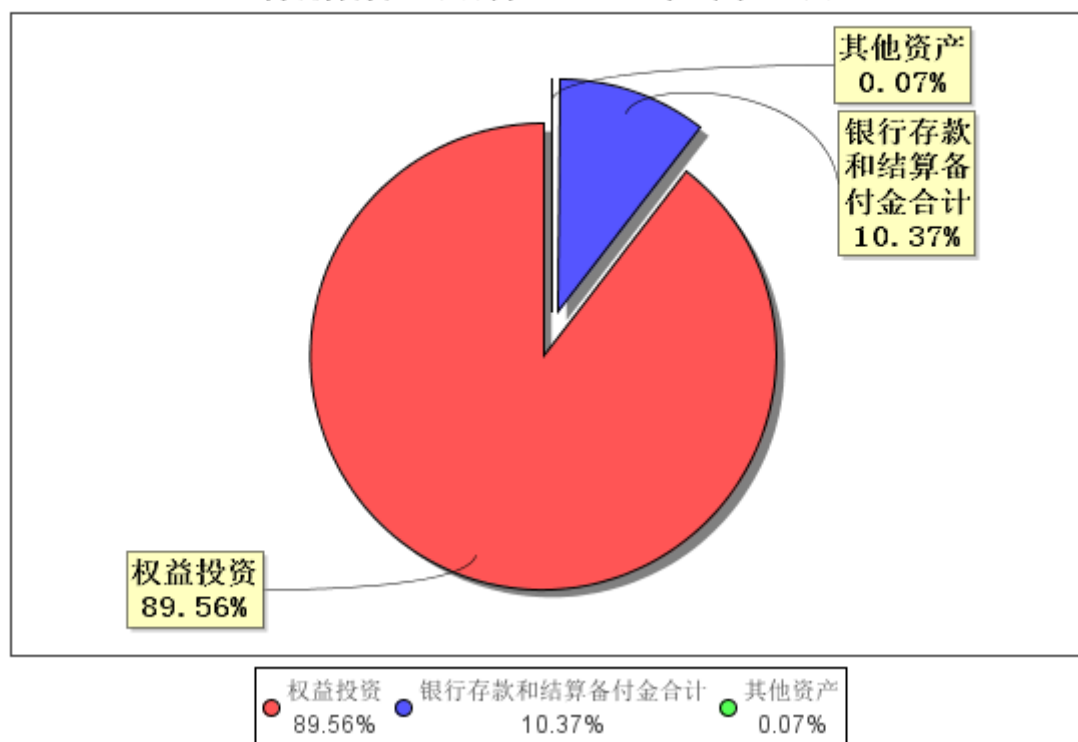
**业绩比较基准** 沪深300指数收益率×55%+中国债券综合全价指数收益率×45%

**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预期风险较高、预期收益较高的基金产品。本基金力争通过资产配置、精选个股等投资策略的实施和积极的风险管理而追求较高收益。

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。

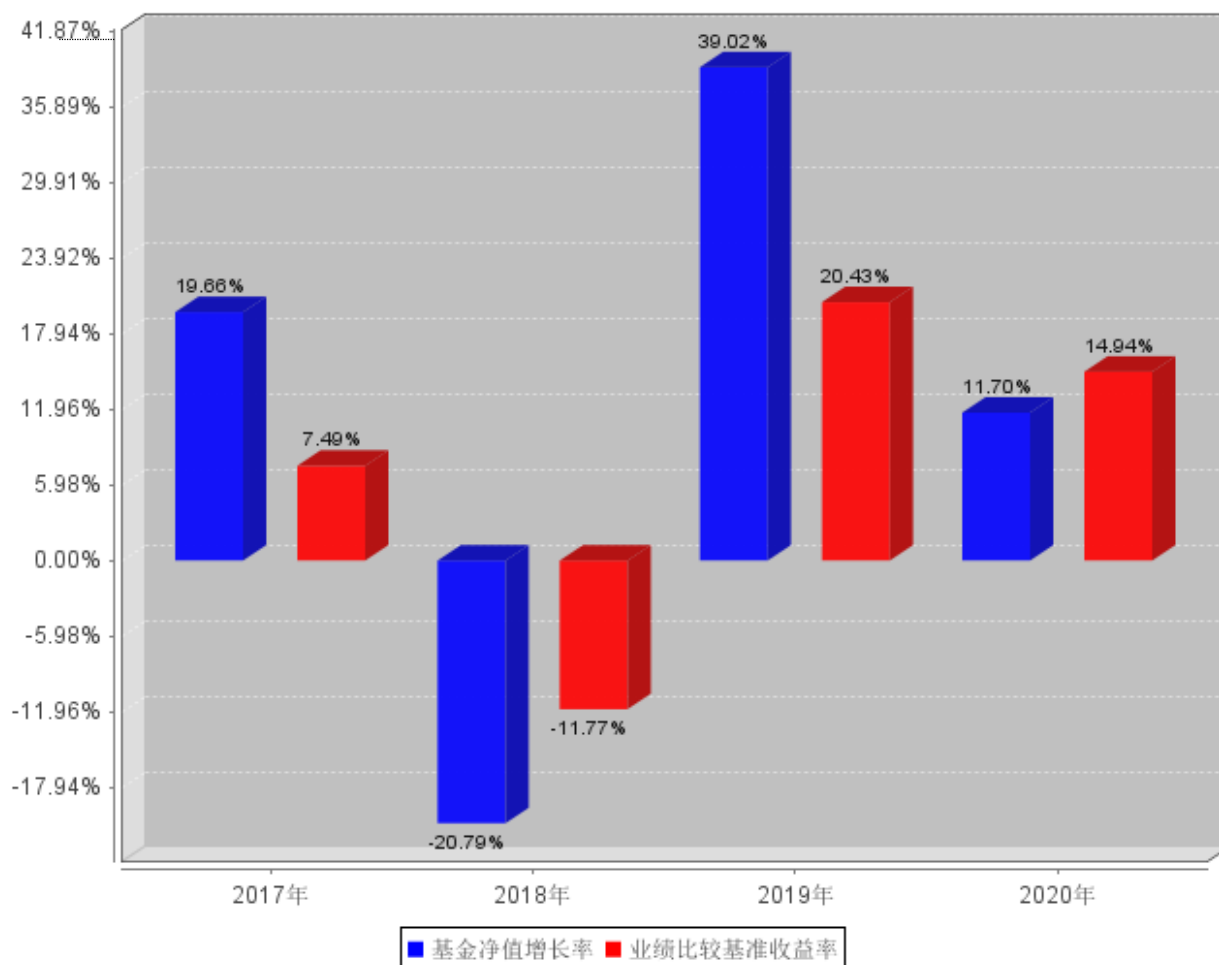
**(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表**

**投资组合资产配置图表**  
数据截止日期：2021年6月30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

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2020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：

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	1.2%	-
	2,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.8%	-
	M ≥ 5,000,000	1000元/笔	-
赎回费	N < 7天	1.5%	-
	7天 ≤ N < 30天	0.75%	-
	30天 ≤ N < 365天	0.5%	-
	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%
销售服务费	-
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

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：

#### （1）与量化投资策略相关的风险

本基金采用量化选股与择时模型指导投资决策，随着市场环境的变化，策略有效性可能受到影响，模型核心参数的设定也会对基金整体收益产生影响，因此，相比普通混合型基金，本基金面临特定量化投资策略带来的风险。

#### （2）投资股指期货的风险

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。

#### （3）投资资产支持证券的风险

本基金可投资于资产支持证券，面临与资产支持证券相关的风险，主要包括资产支持证券信用增级措施相关风险、资产支持证券的利率风险、资产支持证券的流动性风险、评级风险以及与基础资产相关的原始权益人破产、现金流预测等风险，上述风险可能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。

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](http://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

-