

# 东吴安鑫量化灵活配置型证券投资基金

## 更新招募说明书摘要

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

### 【重要提示】

本基金根据【2016】年【1】月【28】日中国证券监督管理委员会《关于同意东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》（证监基金字【2016】【198】号）的注册募集，本基金的基金合同于2016年6月3日正式生效。

基金管理人保证《东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”或“本《招募说明书》”）的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会注册，但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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险，基金运作风险等等。此外，本基金以1元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在单位份额净值跌破1元初始面值的风险。

基金投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》等信息披露文件。本基金是一只混合型基金，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。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资者有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资者投资于本基金时应认真阅读本《招募说明书》。全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，并自行承担投资风险。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本次更新招募说明书仅涉及基金经理更新，相关信息更新截止日为2020年7月23日。其余所载内容截止日为2020年1月31日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年12月31日(财务数据未经审计)。

## 一、基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：东吴基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区源深路279号(200135)

办公地址：上海市浦东新区源深路279号(200135)

法定代表人：邓晖

设立日期：2004年9月2日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【2004】132号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1亿元人民币

联系人：贾云鹏

电话：(021) 50509888

传真：(021) 50509884

客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、021-50509666

网址：www.scfund.com.cn

#### 1、股权结构：

持股单位	占总股本比例
东吴证券股份有限公司	70%
海澜集团有限公司	30%
合计	100%

#### 2、简要情况介绍：

公司实行董事会领导下的总经理负责制，公司总经理下设权益投资总部、固定收益总部、专户投资总部、研究策划部、集中交易室、产品策略部、渠道业务部、机构业务部、战略客户部、营销管理部、互联网金融部、基金事务部、信息技术部、办公室、财务管理部、合规风控部、深圳业务总部、苏州分公司等十八个一级部门。

## 二、主要人员情况

### 1、董事会成员

马震亚先生，董事长，硕士，高级经济师，会计师，中共党员。历任苏州市审计局科员、副主任科员；苏州证券有限责任公司财务部副总经理（主持工作）；东吴证券有限责任公司财务部总经理，财务总监，东吴证券股份有限公司党委委员、纪委书记、董事、副总裁、财务负责人，现任东吴基金管理有限公司董事长。

汤勇先生，董事，工商管理 EMBA，注册会计师，中共党员。历任江苏悦达时装有限公司财务会计、新能（张家港）能源有限公司计财处主任，现任海澜集团有限公司海澜资本投资部投资总监。

邓晖先生，董事，硕士研究生，中共党员。历任长江证券有限责任公司董事、副总裁，湘财证券有限责任公司副总裁，德邦证券有限责任公司副总裁，总裁兼德邦期货有限公司董事长，齐鲁证券有限公司党委委员、副总裁、总裁，长江证券（上海）资产管理有限公司董事长，长江成本资本投资有限公司董事长，长江证券股份有限公司党委副书记、总裁、副董事长、监事长，现任东吴基金管理有限公司总经理。

冯恂女士，董事，博士研究生，经济师，中共党员。历任东吴证券研究所研究员，国联证券研究所所长、总裁助理兼经管总部总经理、副总裁，东吴证券总规划师兼研究所所长、兼资产管理部总经理、总规划师，现任东吴证券股份有限公司党委委员、副总裁、资产管理部总经理。

陈建国先生，董事，硕士研究生，经济师，中共党员。历任昆山市信托投资公司第二证券部副经理，东吴证券昆山前进中路证券营业部副总经理、福州湖东路证券营业部总经理、昆山分公司副总经理、东吴证券经纪管理总部副总经理（主持工作），现任东吴证券人力资源部总经理。

周虹女士，董事，本科学历，现任海澜集团有限公司海澜资本投资部投资经理。

张婉苏女士，独立董事，经济法博士。历任担任斯洛文尼亚道迈尔机电有限责任公司苏州代表处法律顾问、南京大学法学院助教、讲师，现任南京大学法学院副教授。

袁勇志先生，独立董事，教授，博士生导师。历任苏州大学管理学院教师、苏州大学人文社科处处长、苏州大学党委研究生工作部部长，现任苏州大学出版社副总编。

方志刚先生，独立董事，大学学历，民建会员。企业类会计师、中国注册会计师、澳洲注册会计师。历任上海上审会计师事务所审计员、部门经理，上海长信会计师事务所部门经理，上海锦江国旅股份有限公司财务部经理、上海实业联合集团长城药业有限公司财务总监；上海众华沪银会计师事务所高级经理，现任瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）上海分所工作，权益合伙人，担任长方集团股份有限公司独立董事。

## 2、监事会成员

张剑宏先生，监事会主席，硕士。历任苏州物资集团公司公司政策研究室科长、财务公司证券部总经理助理、办公室副主任、主任；东吴证券三香路营业部（原苏物贸证券营业部）总经理、总裁助理兼投资银行总部总经理、风险管理部、合规法务部总经理、合规总监兼首席风险官，现任东吴创业投资有限公司董事长。

王菁女士，监事，本科学士学位，会计师，中共党员。历任东吴证券经纪分公司财务经理、东吴证券财务部总经理助理、副总经理，现任东吴证券股份有限公司财务部总经理。

沈清韵女士，员工监事，硕士研究生，中共党员。历任普华永道中天会计师事务所高级审计员，东吴基金管理有限公司监察稽核部总经理，合规风控部总经理，现任合规风控部总经理，董事会秘书。

## 3、高管人员

马震亚先生，董事长，硕士，高级经济师，会计师，中共党员。历任苏州市审计局科员、副主任科员；苏州证券有限责任公司财务部副总经理（主持工作）；东吴证券有限责任公司财务部总经理，财务总监，东吴证券股份有限公司党委委员、纪委书记、董事、副总裁、财务负责人，现任东吴基金管理有限公司董事长。

邓晖先生，董事，硕士研究生，中共党员。历任长江证券有限责任公司董事、副总裁，湘财证券有限责任公司副总裁，德邦证券有限责任公司副总裁，总裁兼德邦期货有限公司董事长，齐鲁证券有限公司党委委员、副总裁、总裁，长江证券（上海）资产管理有限公司董事长，长江成本资本投资有限公司董事长，长江证券股份有限公司党委副书记、总裁、副董事长、监事长，现任东吴基金管理有限公司总经理。

徐明先生，副总经理，硕士，中共党员。历任中国银行苏州分行营业部会计；苏州华纺经济贸易有限公司财务科会计；中创证券有限责任公司苏州十全街营业部副总经理；东吴证券有限责任公司胥江路证券营业部副总经理，总经理；东吴证券股份有限公司石路证券营业部总经理，太仓分公司总经理，常熟分公司总经理；东吴基金管理有限公司营销总监兼营销管理部总经理，现任东吴基金管理有限公司副总经理。

吕晖先生，督察长，大专，历任苏州商业大厦业务员，苏州证券公司交易员，苏州证券登记公司总经理助理，东吴证券资产管理总部副总经理，东吴证券吴江盛泽西环路营业部、吴江中山北路营业部总经理，东吴基金管理有限公司总经理助理、运营总监、东吴基金管理有限公司副总经理，现任东吴基金管理有限公司督察长。

## 4、基金经理

周健，硕士，南开大学毕业。曾就职于海通证券；2011年5月加入东吴基金管理有限公司，曾任公司研究策划部研究员，现任基金经理，自2019年5月30日起担任东吴国企改革主

题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2020 年 1 月 18 日起任东吴中证新兴产业指数证券投资基金、东吴沪深 300 指数型证券投资基金基金经理，自 2020 年 7 月 23 日起担任东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理。其中，2012 年 10 月 27 日至 2015 年 5 月 29 日担任东吴新创业混合型证券投资基金基金经理，2016 年 2 月 3 日至 2017 年 4 月 19 日担任东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 2 月 5 日至 2017 年 4 月 19 日担任东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2012 年 05 月 03 日至 2018 年 12 月 13 日担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理、2013 年 6 月 5 日至 2018 年 12 月 13 日担任东吴沪深 300 指数型证券投资基金（2018 年 7 月 11 日由原东吴深证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）转型）、2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日担任东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 8 月 11 日至 2018 年 12 月 13 日担任东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

历任基金经理：

周健 2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日

秦斌 2016 年 7 月 7 日至 2020 年 7 月 23 日

#### 5、投资决策委员会成员

（1）权益投资决策委员会：杜毅、彭敢、刘元海、戴斌、王立立、刘瑞、赵梅玲。杜毅任权益投资决策委员会主席，魏西、高通为权益投资决策委员会秘书。

（2）固收投资决策委员会：陈晨、何杰、王文华、黄婧丽、魏西。陈晨任固收投资决策委员会主席，邵笛为固收投资决策委员会秘书。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：江苏银行股份有限公司（简称“江苏银行”）

住所：江苏省南京市中华路 26 号

办公地址：江苏省南京市中华路 26 号

法定代表人：夏平

成立时间：2007 年 1 月 22 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：115.44 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：证监许可【2014】619号

联系人：蔡越

电话：025 - 51811157

## 2、主要人员情况

江苏银行托管业务条线现有员工62名，来自于基金、券商、托管行等不同的行业，具有会计、金融、法律、IT等不同的专业知识背景，团队成员具有较高的专业知识水平、良好的服务意识、科学严谨的态度；部门管理层有20年以上金融从业经验，精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

2014年，江苏银行先后获得基金托管业务资格及保险资金托管业务资格。江苏银行依靠严密科学的风险管理和内部控制体系以及先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务。目前江苏银行的托管业务产品线已涵盖公募基金、信托计划、基金专户、基金子公司专项资管计划、券商资管计划、产业基金、私募投资基金等。江苏银行将在现有的基础上开拓创新继续完善各类托管产品线。江苏银行同时可以为各类客户提供现金管理、绩效评估、风险管理等个性化的托管增值服务。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### 1、内部风险控制目标

- (1) 确保有关法律法规在托管业务中得到全面严格的贯彻执行；
- (2) 确保我行有关托管的各项管理制度和业务操作规程在托管业务中得到全面严格的贯彻执行；
- (3) 确保资产安全，保证托管业务稳健运行。

2、内部风险控制组织结构 由江苏银行内审部和资产托管部内设的监察稽核人员构成。资产托管部内部设置专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。

### 3、内部风险控制原则

- (1) 全面性原则。“实行全员、全程风险控制方法”，内部控制必须渗透到托管业务的各个操作环节，覆盖所有的岗位，不能留有任何死角。
- (2) 预防性原则。必须树立“预防为主”的管理理念，以业务岗位为主体，从风险发生的源头加强内部控制，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生。
- (3) 及时性原则。各团队要及时建立健全各项规章制度，采取有效措施加强内部控制。

发现问题，要及时处理，堵塞漏洞。

(4) 独立性原则。托管业务内部控制机构必须独立于托管业务执行机构，业务操作人员和检查人员必须分开，以保证内控机构的工作不受干扰。

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

#### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用投资监督系统，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### 2、监督流程

(1) 每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 三、相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构：

名称：东吴基金管理有限公司直销中心

注册地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

办公地址：上海市浦东新区源深路 279 号（200135）

法定代表人：邓晖

联系人：贾云鹏

直销电话：(021) 50509880

传真：(021) 50509884

客户服务电话：400-821-0588（免长途话费）、(021) 50509666

网站：www.scfund.com.cn

## 2、代销机构：

## (1) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

客服电话：95599

公司网址：www.abchina.com

## (2) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

客服电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

## (3) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

客服电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

## (4) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市江东区中山东路 294 号

办公地址：宁波市鄞州区宁南路 700 号宁波银行大楼

法定代表人：陆华裕

客服电话：96528，上海地区 962528

公司网址：www.nbc.com.cn

## (5) 江苏银行股份有限公司

注册地址：南京市中华路 26 号

办公地址：南京市中华路 26 号

法定代表人：夏平

客服热线：95319

公司网址：www.jsbchina.cn

## (6) 苏州银行股份有限公司



注册地址：江苏省苏州工业园区钟园路 728 号

办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

法定代表人：王兰凤

客服热线：96067

公司网址：[www.suzhoubank.com](http://www.suzhoubank.com)

(7) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505

法定代表人：林义相

公司网址：<http://www.txsec.com>

(8) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客服热线：400-920-0022

公司网址：<http://licaike.hexun.com/>

(9) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：江苏省南京市鼓楼区中山北路 105 号中环国际 1413 室

法定代表人：吴言林

客服热线：025-56663409

公司网址：[www.huilinbd.com](http://www.huilinbd.com)

(10) 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋

法定代表人：汪静波

客服热线：400-821-5399

公司网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(11) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

法定代表人：薛峰

客服热线：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

(12) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法定代表人：其实

客服热线：95021/400-1818-188

公司网址：http://fund.eastmoney.com

(13) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

客服热线：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

(14) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座

法定代表人：陈柏青

客服热线：4000766123

公司网址：www.fund123.cn

(15) 上海长量基金销售有限公司

代销机构：上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-820-2899

公司网站：www.erichfund.com

(16) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

客服热线：4008-773-772

公司网址: [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(17) 上海利得基金销售有限公司

注册地址: 上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址: 上海市浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 14 层

法定代表人: 李兴春

客服电话: 400-921-7755

公司网址: [www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn)

(18) 浙江金观诚基金销售有限公司

注册地址: 杭州市拱墅区登云路 45 号 (锦昌大厦) 1 幢 10 楼 1001 室

办公地址: 杭州市拱墅区登云路 45 号锦昌大厦一楼金观诚财富

法定代表人: 蒋雪琦

客服热线: 400-068-0058

公司网址: [www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

(19) 宜信普泽 (北京) 基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址: 北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人: 戎兵

客服热线: 400-6099-200

公司网址: [www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

(20) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址: 南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人: 王锋

客服热线: 95177

公司网址: [www.snjjjin.com](http://www.snjjjin.com)

(21) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址: 北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址: 北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室

法定代表人: 周斌

客服热线: 4008980618

公司网址: [www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

(22) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层

法定代表人：王伟刚

客服热线：400-619-9059

公司网址：[www.hcjijin.com](http://www.hcjijin.com)

(23) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区万通中心 D 座 21&28 层

法定代表人：蒋煜

客服热线：010-58170761

公司网址：<http://www.shengshiview.com.cn/>

(24) 一路财富（北京）基金销售股份有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

办公地址：北京市海淀区奥北科技园-国泰大厦 9 层

法定代表人：吴雪秀

客服热线：400-001-1566

公司网址：<http://www.yilucaifu.com/>

(25) 北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

客服热线：400-678-5095

公司网址：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

(26) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人：于龙

客服热线：4006-802-123

公司网址：<https://www.zhixin-inv.com/>

(27) 成都华羿恒信基金销售有限公司

注册地址：成都市高新区蜀锦路 88 号新中泰国际大厦 1 号楼 32F2 号

办公地址：成都市高新区蜀锦路 88 号新中泰国际大厦 1 号楼 32F2 号

法定代表人：赵壁

客服热线：028-87326832

公司网址：<http://www.huayihengxin.com>

(28) 北京加和基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 11 号 7 层 703 室

办公地址：北京市西城区金融大街 11 号 7 层 703 室

法定代表人：曲阳

客服热线：400-803-1188

公司网址：<http://www.bzfunds.com/>

(29) 杭州科地瑞富基金销售有限公司

注册地址：杭州市下城区武林时代商务中心 1604 室

办公地址：杭州市下城区上塘路 15 号武林时代 20F

法定代表人：陈刚

客服热线：0571-86915761

公司网址：[www.cd121.com](http://www.cd121.com)

(30) 上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人：王廷富

客服热线：400-821-0203

(31) 上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

客服热线：400-166-6788

公司网址：<http://www.66zichan.com>

(32) 上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元

办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋汇付天下总部大楼 2 楼

法定代表人：金佶

客服热线：400-821-3999

公司网址：[www.hotjijin.com](http://www.hotjijin.com)

## (33) 北京微动利基金销售有限公司

注册地址：北京市石景山区古城西路 113 号 3 层 342 室

办公地址：北京市石景山区古城西路 113 号 3 层 342 室

法定代表人：季长军

客服热线：400-188-5687

公司网址：[www.buyforyou.com.cn](http://www.buyforyou.com.cn)

## (34) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

客服热线：400-820-5369

公司网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

## (35) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：王之光

客户服务电话：4008219031

网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

## (36) 大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：姚杨

客服热线：021-22267943

公司网址：<http://www.dtfortune.com/>

## (37) 珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 1201-1203 室（邮编：510308）

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

网址：<http://www.yingmi.cn/>

## (38) 奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEOWEEHOWE（张伟豪）

客服热线：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

## (39) 北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京是海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

办公地址：北京市海淀区显龙山路19号1幢4层1座401

法定代表人：江卉

客服热线：95118

公司网址：fund.jd.com

## (40) 中民财富管理（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元

办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层

法定代表人：弭洪军

客服热线：400-876-5716

公司网址：www.cmiwm.com

## (41) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

客户服务电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com

## (42) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：杨德红

客户服务热线：95521/4008888666

公司网址：<http://www.gtja.com>

(43) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝内大街 188 号

法定代表人：张佑君

客服电话：400-8888-108

公司网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(44) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

公司网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

(45) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：霍达

客服电话：95565、4008888111

公司网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(46) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客服热线：95548

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(47) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈共炎

客服电话：4008-888-888 或 95551

公司网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(48) 海通证券股份有限公司



注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客服电话：021-23219000

公司网址：www.htsec.com

(49) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层（邮编：200031）

客服电话：95523 或 4008895523

公司网址：www.swhysc.com

联系人：黄莹

(50) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人：杨华辉

客服电话：95562

公司网址：www.xyzq.com

(51) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

客服电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：www.95579.com

(52) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02

法定代表人：王连志

客服电话：95517

公司网址：www.essence.com.cn

(53) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

客服热线：95355、4008096096

公司网址：www.swsc.com.cn

(54) 万联证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层

办公地址：广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 层

法定代表人：张建军

客服热线：4008888133

公司网址：www.wlzq.com.cn

(55) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：王春峰

客服电话：400-6515-988

公司网址：www.ewww.com.cn

(56) 华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：周易

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(57) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

客服电话：95548

公司网址：www.zxzqsd.com.cn

(58) 东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街 5 号

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

客服电话：0512-33396288/95530

公司网址: [www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

(59) 信达证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址: 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人: 张志刚

客服电话: 95321

公司网址: [www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

(60) 光大证券股份有限公司

注册地址: 上海市静安区新闻路1508号

办公地址: 上海市静安区新闻路1508号

法定代表人: 周健男

客服电话: 95525

公司网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(61) 广州证券股份有限公司

注册地址: 广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19、20楼

办公地址: 广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19、20楼

法定代表人: 邱三发

客服电话: 020-961303

公司网址: [www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

(62) 上海证券有限责任公司

注册地址: 上海市黄浦区四川中路213号7楼

办公地址: 上海市黄浦区四川中路213号7楼

法定代表人: 李俊杰

传真: 021-53686100, 021-53686200

网址: [www.shzq.com](http://www.shzq.com)

(63) 国联证券股份有限公司

注册地址: 无锡市金融一街8号

办公地址: 无锡市金融一街8号国联大厦

法定代表人: 姚志勇

客服电话: 95570

公司网址: [www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn)

(64) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层（518048）

法定代表人：谢永林

客服热线：95511-8

公司网址：www.PINGAN.com

（65）华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：章宏韬

客服电话：95318

公司网址：www.hazq.com

（66）国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：何春梅

客服热线：95563

公司网址：www.ghzq.com.cn

（67）财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26-28 楼

法定代表人：蔡一兵

客服电话：95317

公司网址：www.cfzq.com

（68）东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：钱俊文

客服电话：95531；400-8888-588

网址：www.longone.com.cn

（69）申万宏源（西部）证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

(邮编: 830002)

法定代表人: 韩志谦

客户服务电话: 400-800-0562

网址: [www.hysec.com](http://www.hysec.com)

(70) 中泰证券股份有限公司

注册地址: 山东省济南市经七路 86 号 23 层

办公地址: 山东省济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人: 李玮

客服电话: 95538

公司网址: [www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

(71) 中航证券有限公司

注册地址: 江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址: 北京市朝阳区望京东园四区 2 号中航资本大厦 35 层

法定代表人: 王晓峰

客服电话: 95335

公司网址: [www.avicsec.com](http://www.avicsec.com)

(72) 上海华信证券有限责任公司

注册地址: 上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

办公地址: 上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法定代表人: 罗浩

客服热线: 68777877

公司网址: [www.cf-clsa.com](http://www.cf-clsa.com)

(73) 五矿证券有限公司

注册地址: 深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 47 层

办公地址: 深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心 47-49 层

法定代表人: 张永衡

客服热线: 40018-40028

公司网址: [www.wkzq.com.cn](http://www.wkzq.com.cn)

(74) 华鑫证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

办公地址: 上海市徐汇区宛平南路 8 号

法定代表人: 俞洋

客户服务电话：95323；4001099918

公司网站：www.cfsc.com.cn

(75) 中国中金财富证券有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

客服热线：4006008008

公司网址：www.china-invs.cn

(76) 西藏东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：陈宏

客服热线：95357

公司网址：<http://www.18.cn>

(77) 国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客服热线：95310

公司网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

(78) 华宝证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

法定代表人：陈林

客服电话：4008209898

公司网址：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

(79) 爱建证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

法定代表人：祝健

客服电话：4001962502

公司网址: [www.ajzq.com](http://www.ajzq.com)

(80) 方德保险代理有限公司

注册地址: 北京市东城区东直门南大街3号楼7层711

办公地址: 北京市东城区东直门外大街22号天恒大厦B座U•work12层02室

法定代表人: 林柏均

客服热线: 010-64068617

公司网址: [www.fdsure.cn](http://www.fdsure.cn)

(81) 华瑞保险销售有限公司

注册地址: 上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层

办公地址: 上海市浦东区向城路288号国华金融大厦8楼

法定代表人: 路昊

客服热线: 952303

公司网址: <http://www.huaruisales.com>

(82) 阳光人寿保险股份有限公司

注册地址: 海南省三亚市河东区三亚河东路海唐商务12、13层

办公地址: 北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层

法定代表人: 李科

客服热线: 4006-802-123

公司网址: <https://www.zhixin-inv.com/>

3、基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定, 选择其他符合要求的机构销售本基金, 并及时履行公告义务。

## 二、登记机构: 东吴基金管理有限公司

注册地址: 上海市浦东新区源深路279号(200135)

办公地址: 上海市浦东新区源深路279号(200135)

法定代表人: 邓晖

联系人: 贾云鹏

电话: 021-50509888

传真: 021-50509884

客户服务电话: 400-821-0588(免长途话费)、021-50509666

网站: [www.scfund.com.cn](http://www.scfund.com.cn)

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称: 上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼  
办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼  
负责人：俞卫锋  
电话：(021) 31358666  
传真：(021) 31358600  
联系人：陆奇  
经办律师：黎明、陆奇

#### 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）  
住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层  
执行事务合伙人：毛鞍宁  
电话：010-58153000  
传真：010-85188298  
联系人：徐艳  
经办注册会计师：徐艳、张亚旋

#### 四、基金的名称

本基金名称：东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金

#### 五、基金的类型

本基金类型：混合型基金

#### 六、基金的投资目标

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。

#### 七、基金的投资方向

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。

## 八、基金的投资策略

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,以期给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。

本基金多因子模型是以动能因子、价值因子和成长因子等为参考指标进行行业的优选。其中,体现量价关系的动能因子包括但不限于:PVT(价量趋势)、OSC(变动速率)、MI(动量指标)、CCI(顺势指标)、个股收盘价的变动速率/标的指数收盘价的变动速率与个股日均成交量增速/标的指数日均成交增速等;体现基本面因素的价值因子和成长因子包括但不限于每股净资产与价格比率(B/P)、每股收益与价格比率(E/P)与主营业务收入增长率、净利润增长率等指标。

#### 2、替代成份股

当子行业成份股因投资限制、或者停牌、流动性不足、或者财务风险较大、面临重大的不利司法诉讼、被市场操纵等情形,导致基金无法配置的情况下,本基金将选择动能因子排序靠前的股票进行替代。

### (三) 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。

#### （四） 股指期货投资策略

本基金将以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货投资，达到管理投资组合系统性风险以及加强现金管理的目的。

#### （五） 权证投资策略

本基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。具体投资方法如下：

考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率及无风险收益率等要素，估计权证合理价值。

根据权证合理价值与其市场价格间的差幅以及权证合理价值对定价参数的敏感性，结合标的股票合理价值考量，决策买入、持有或沽出权证。

#### （六） 固定收益类资产投资策略

本基金固定收益类资产的投资目标主要为非股票资产的有效使用和管理。在实际管理中，辅助配置短久期、流动性较好的固定收益类资产以及保持类现金资产以应对申购赎回资金流、交易成本等因素为本基金固定收益类资产的主要投资策略。

## 九、基金的业绩比较基准

基金业绩比较基准为： $65\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 35\% \times \text{中国债券综合全价（总值）指数收益率}$ 。

## 十、基金的风险收益特征

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。

## 十一、基金的投资组合报告

东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)基金管理人的董事会及董事保证本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。

本基金的托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年1月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2019年12月31日（未经审计）。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	83,178,026.59	69.95
	其中：股票	83,178,026.59	69.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	35,315,044.75	29.70
8	其他资产	414,490.23	0.35
9	合计	118,907,561.57	100.00

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,730,400.00	1.46
B	采矿业	1,290,020.00	1.09
C	制造业	35,372,614.27	29.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,680,368.00	1.42

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	653,422.00	0.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	604,314.00	0.51
J	金融业	35,510,689.08	29.91
K	房地产业	4,291,420.00	3.61
L	租赁和商务服务业	729,390.00	0.61
M	科学研究和技术服务业	438,491.20	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	870,320.00	0.73
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	83,178,026.59	70.05

## 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	8,000	9,464,000.00	7.97
2	601318	中国平安	100,800	8,614,368.00	7.25
3	000651	格力电器	72,000	4,721,760.00	3.98
4	600276	恒瑞医药	51,200	4,481,024.00	3.77
5	600036	招商银行	108,700	4,084,946.00	3.44
6	601166	兴业银行	153,000	3,029,400.00	2.55
7	600030	中信证券	110,600	2,798,180.00	2.36
8	000333	美的集团	40,000	2,330,000.00	1.96
9	600585	海螺水泥	39,800	2,181,040.00	1.84
10	600837	海通证券	136,300	2,107,198.00	1.77

## 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

## 9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

## 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

## 10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

## 10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 11、投资组合报告附注

## 11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

## 11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

## 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	401,244.67

2	应收证券清算款	5,672.39
3	应收股利	-
4	应收利息	7,473.32
5	应收申购款	99.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	414,490.23

#### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十二、基金的业绩

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### 一、东吴安鑫量化基金历史时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016.06.03-2016.12.31	-2.60%	0.58%	2.50%	0.55%	-5.10%	0.03%
2017.01.01-2017.12.31	14.69%	0.35%	8.67%	0.42%	6.02%	-0.07%
2018.01.01-2018.12.31	-11.13%	0.58%	-16.12%	0.87%	4.99%	-0.29%
2019.01.01-2019.12.31	27.31%	0.57%	22.37%	0.82%	4.94%	-0.25%
2016.06.03-2019.12.31	26.39	0.53	11.41	0.71	14.98	-0.18

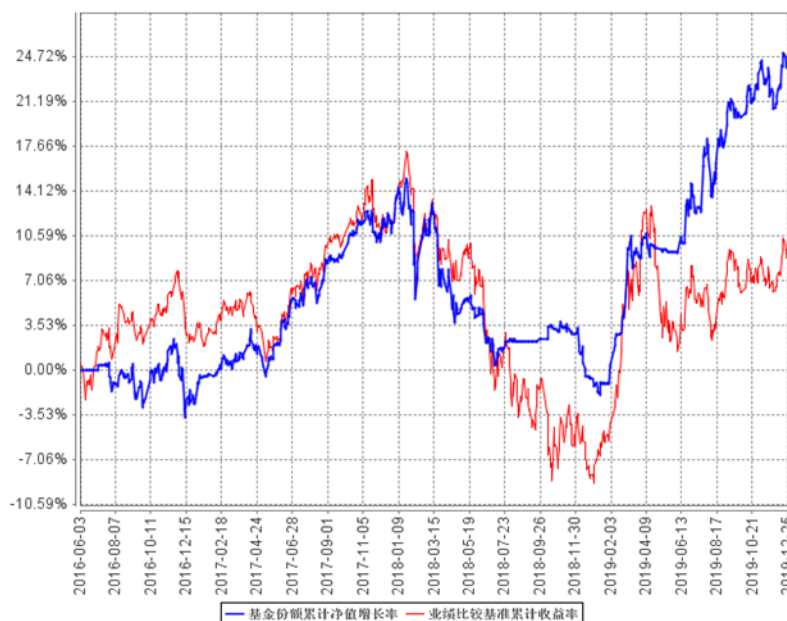
注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 二、自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩基准收益率的比较图

（2016年06月03日至2019年12月31日）

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金业绩比较基准=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

### 十三、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### 1、基金转换业务的适用范围

本基金已开通与本基金管理人旗下基金：东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金（基金代码：580001）、东吴价值成长双动力混合型证券投资基金（基金代码：580002）、东吴行业轮动混合型证券投资基金（基金代码：580003）、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金（基金代码：580005）、东吴新经济混合型证券投资基金（基金代码：580006）、东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：580007）、东吴新产业精选混合型证券投资基金（基金代码：580008）、东吴中证新兴产业指数证券投资基金（基金代码：585001）、东吴优信稳健债券型证券投资基金 A（基金代码：582001）、东吴优信稳健债券型证券投资基金 C（基金代码：582201）、东吴增利债券型证券投资基金 A（基金代码：582002）、东吴增利债券型证券投资基金 C（基金代码：582202）、东吴货币市场证券投资基金 A（基金代码：583001）、东吴货币市场证券投资基金 B（基金代码：583101）、东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：582003）、东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：580009）、东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：000531）、东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金 A（基金代码：001323）、东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金（基金代码：

001322)、东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:002159)、东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:002270)、东吴鼎元双债债券型证券投资基金A(基金代码:000958)、东吴鼎元双债债券型证券投资基金C(基金代码:000959)、东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:002919)、东吴增鑫宝货币市场基金A(基金代码:003588)、东吴增鑫宝货币市场基金B(基金代码:003589)、东吴优益债券型证券投资基金A(基金代码:005144)、东吴优益债券型证券投资基金C(基金代码:005145)、东吴双三角股票型证券投资基金A(基金代码:005209)、东吴双三角股票型证券投资基金C(基金代码:005210)、东吴悦秀纯债债券型证券投资基金A(基金代码:005573)、东吴悦秀纯债债券型证券投资基金C(基金代码:005574)、东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金(基金代码:006026)的基金转换业务。

基金管理人今后发行的开放式基金将根据具体情况确定是否适用于基金转换业务,并将另行公告。

## 2、开通转换的销售机构

投资者可通过基金管理人的直销渠道和以下代销机构办理以上基金的基金转换业务:

交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、天相投资顾问有限公司、和讯信息科技有限公司、江苏汇林保大基金销售有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司、上海长量基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、浙江金观诚基金销售有限公司、宜信普泽(北京)基金销售有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、北京晟视天下投资管理有限公司、一路财富(北京)基金销售股份有限公司、北京钱景基金销售有限公司、成都华羿恒信基金销售有限公司、北京加和基金销售有限公司、杭州科地瑞富基金销售有限公司、上海万得基金销售有限公司、上海联泰基金销售有限公司、上海汇付基金销售有限公司、北京微动利基金销售有限公司、上海基煜基金销售有限公司、大泰金石基金销售有限公司、珠海盈米基金销售有限公司、奕丰基金销售有限公司、北京肯特瑞基金销售有限公司、中民财富管理(上海)有限公司、中信期货有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、兴业证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、东吴证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、平安证



券股份有限公司、华安证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、申万宏源（西部）证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中航证券有限公司、上海华信证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、中国中金财富证券有限公司、西藏东方财富证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、方德保险代理有限公司、阳光人寿保险股份有限公司。

根据业务需要，本基金管理人还将会选择其他销售机构开办此业务并将按有关规定予以公告。

## 十四、费用概览

### 一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金账户开户费用、账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 3-9 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、与基金销售有关的费用

#### 1、收费模式

##### (1) 申购费

本基金的申购费用由申购基金份额的投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。具体申购费率如下：

申购金额 M(含申购费)	申购费率
M<100 万	1.50%
100 万≤M<200 万	1.20%
200 万≤M<500 万	0.80%
500 万≤M<1000 万	0.3%
M≥1000 万	1000 元/笔

##### (2) 赎回费

本基金赎回费由赎回人承担，在投资者赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，并将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期不少于 6 个月的投资人，将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。未计入基金财产的赎回费用于

支付登记费和其他必要的手续费。

赎回费随基金持有时间的增加而递减,费率如下:

持有时间 T	赎回费率
T<7 日	1.50%
7 日≤T<30 日	0.75%
30 日≤T<1 年	0.5%
1 年≤T<2 年	0.25%
T≥2 年	0%

注:1 个月指 30 日,1 年指 365 日

2、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

3、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按中国证监会要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率并进行公告。

## 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求,本基金管理人对本基金原招募说明书进行了更新,并根据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要更新的内容如下:

1、在“三、基金管理人”中,对相关内容进行了更新。

东吴基金管理有限公司  
二零二零年七月二十七日