

东吴基金



东吴基金管理有限公司
Soochow Asset Management Co., Ltd.

地址：上海浦东新区源深路279号

邮编：200135

总机：021-50509888

传真：021-50509884

公司网址：www.scfund.com.cn

客服邮箱：service@scfund.com.cn

客服热线：400-821-0588

021-50509666

出版部门：东吴基金市场营销部

风险提示：

本刊所提供资讯仅供参考，本公司对这些信息的准确性及完整性不作任何保证。在任何情况下本刊物中的信息或所表达的意见并不构成实际投资结果，也不构成任何对投资人的投资建议。投资有风险，敬请谨慎选择。

基金周报

2016年2月1日

总第543期

专业理财交给我们 美好生活还给自己

基金数据

- 一周净值
- 基金表现

东吴视点

- 基金经理手记：市场格局仍延续偏弱态势

东吴动态

- “熔断”时代 东吴安盈基金凸显量化优势
- 谋求稳定收益 东吴安盈量化基金正式发行
- 引入量化策略 东吴国企改革基金谋稳健收益

常见问题

- 目前的电子服务类型有哪些？
- 如何更改邮寄地址或其他联系方式？
- 新基金何时可以查到认购结果？



扫一扫 关注东吴基金微信



基金数据

○ 一周净值

基金名称	2016-1-25		2016-1-26		2016-1-27		2016-1-28		2016-1-29	
	单位	累计								
	净值	净值								
东吴嘉禾优势	0.7652	2.4852	0.7080	2.4280	0.6848	2.4048	0.6466	2.3666	0.6745	2.3945
东吴价值成长	1.2906	2.0306	1.1942	1.9342	1.1778	1.9178	1.1144	1.8544	1.1565	1.8965
东吴行业轮动	0.6978	0.7778	0.6454	0.7254	0.6213	0.7013	0.5871	0.6671	0.6110	0.6910
东吴进取策略	1.3316	1.4016	1.2480	1.3180	1.2117	1.2817	1.1593	1.2293	1.1995	1.2695
东吴新经济	1.4160	1.4160	1.3300	1.3300	1.3300	1.3300	1.2820	1.2820	1.3080	1.3080
东吴新创业	1.4380	1.4980	1.3520	1.4120	1.3490	1.4090	1.3030	1.3630	1.3300	1.3900
东吴新产业	1.9050	1.9050	1.7610	1.7610	1.7300	1.7300	1.6370	1.6370	1.6890	1.6890
东吴内需增长	1.6850	1.6850	1.5890	1.5890	1.5870	1.5870	1.5360	1.5360	1.5630	1.5630
东吴配置优化	1.1470	1.1470	1.1190	1.1190	1.1160	1.1160	1.1010	1.1010	1.1130	1.1130
东吴阿尔法	1.1910	1.1910	1.0940	1.0940	1.0540	1.0540	0.9900	0.9900	1.0350	1.0350
东吴新趋势	0.8510	0.8510	0.8000	0.8000	0.7910	0.7910	0.7590	0.7590	0.7800	0.7800
东吴移动互联	1.0000	1.0000	0.9960	0.9960	0.9970	0.9970	0.9950	0.9950	0.9970	0.9970
东吴深证100	1.0810	1.0810	1.0090	1.0090	1.0070	1.0070	0.9770	0.9770	1.0110	1.0110
东吴中证新兴	1.0720	1.0720	0.9980	0.9980	0.9980	0.9980	0.9590	0.9590	0.9910	0.9910
东吴鼎利分级	1.2230	1.2720	1.2230	1.2720	1.2210	1.2700	1.2210	1.2700	1.2210	1.2700
东吴鼎利A	1.0070	1.1150	1.0080	1.1160	1.0080	1.1160	1.0080	1.1160	1.0080	1.1160
鼎利进取	1.2440	1.2440	1.2430	1.2430	1.2420	1.2420	1.2410	1.2410	1.2410	1.2410
东吴可转债	0.9680	0.9140	0.9460	0.8920	0.9510	0.8970	0.9560	0.9020	0.9660	0.9120
可转债A	1.0020	1.0990	1.0020	1.0990	1.0020	1.0990	1.0020	1.0990	1.0020	1.0990
可转债B	0.8890	0.4820	0.8150	0.4080	0.8320	0.4250	0.8490	0.4420	0.8820	0.4750
东吴优信稳健A	1.1047	1.1167	1.0892	1.1012	1.0846	1.0966	1.0767	1.0887	1.0846	1.0966
东吴优信稳健C	1.0773	1.0893	1.0622	1.0742	1.0577	1.0697	1.0500	1.0620	1.0577	1.0697
东吴增利A	1.2580	1.2980	1.2570	1.2970	1.2550	1.2950	1.2540	1.2940	1.2540	1.2940
东吴增利C	1.2360	1.2760	1.2350	1.2750	1.2330	1.2730	1.2310	1.2710	1.2320	1.2720



基金数据

基金名称	2016-1-24		2016-1-25		2016-1-26		2016-1-27		2016-1-28		2016-1-29	
	万份收益	7日年化 (%)										
东吴货币 A	1.4551	2.7920	0.7403	2.8220	0.7269	2.8430	0.7021	2.8440	0.6969	2.6600	1.0249	2.8270
东吴货币 B	1.5863	3.0390	0.8068	3.0700	0.7929	3.0910	0.7706	3.0930	0.7675	2.9110	1.0882	3.0770

○ 基金表现

基金名称	最近一周	最近一月	最近三月	最近六月	最近一年	最近两年	今年以来	设立以来
	回报率 (%)							
东吴嘉禾优势	-11.56	-27.25	-18.15	-23.15	-18.66	-11.44	-26.41	170.79
东吴价值成长	-9.64	-30.12	-20.47	-29.77	-8.49	-3.84	-30.06	91.85
东吴行业轮动	-12.12	-29.96	-20.04	-22.43	-12.06	16.03	-29.29	-34.87
东吴进取策略	-9.14	-23.47	-11.74	-11.31	-7.15	9.20	-22.80	28.30
东吴新经济	-6.24	-24.31	-18.56	-20.39	3.32	44.53	-23.24	30.80
东吴新创业	-6.01	-25.07	-18.65	-22.22	5.89	26.31	-23.83	40.43
东吴新产业	-10.82	-33.21	-22.45	-26.18	1.32	26.61	-32.55	68.90
东吴内需增长	-5.96	-23.94	-17.74	-17.39	7.64	24.74	-22.59	56.30
东吴配置优化	-2.71	-5.44	-6.55	0.00	0.00	0.00	-5.28	-5.84
东吴阿尔法	-12.66	-29.35	-18.63	-25.97	-0.38	0.00	-28.72	3.50
东吴新趋势	-7.69	-25.78	-22.16	-22.31	0.00	0.00	-25.78	-22.00
东吴移动互联	-0.30	-1.29	-0.70	0.20	0.00	0.00	-1.38	-0.30
东吴深证100	-5.69	-24.94	-16.93	-25.22	-11.86	22.55	-23.81	1.10
东吴中证新兴	-6.60	-25.26	-22.76	-29.62	-12.22	21.74	-25.04	-0.90
东吴鼎利分级	-0.25	0.00	2.18	5.34	15.00	24.91	0.00	21.90
东吴可转债	1.68	-10.73	-14.11	-20.12	-45.09	0.00	-9.82	-19.09
东吴优信稳健 A	-1.62	-7.54	-6.82	-4.23	-2.60	10.37	-7.44	9.75
东吴优信稳健 C	-1.63	-7.56	-6.90	-4.41	-2.91	9.58	-7.46	4.75
东吴增利 A	-0.40	0.08	1.62	2.96	8.29	22.22	0.08	30.33
东吴增利 C	-0.32	0.08	1.57	2.75	7.79	21.38	0.08	28.06

数据来源: wind



东吴视点

○ 基金经理手记

市场格局仍延续偏弱态势

徐 增

上周 A 股延续下挫，主板、中小板和创业板均出现不同程度的下跌。截至周五收盘，上证指数报 2737.6 点，周下跌 6.14%；深成指收于 9418.2 点，周下跌 6.86%；创业板收于 1994.07，周下跌 7.23%。上周沪深两市成交额再度萎缩，沪市从上一周的 1 万亿元下降至 9314.22 亿元，深市从上一周的 7626.08 亿元下降至 6311.89 亿元。两市场内融资余额继续由上周的 0.98 万亿元下降至 0.91 万亿元。

外围市场包括欧美股市和大宗商品有所趋稳，这可能受益于两方面的作用：一是大幅调整后的技术性反弹；二是全球流动性宽松预期的上升。考虑到外围国家资产估值处于高位，这些国家本身的基本面尚未出现新的边际变化，外围市场好转的持续性仍需进一步观察。

人民币汇率问题仍为中期市场所关注，一旦 2 月初公布的外汇储备数据显示资本流出压力较去年 12 月份进一步加大，短期内人民币贬值压力存在加剧的潜在风险。考虑到日本央行出台负利率，欧央行大概率继续宽松，人民币面临的竞争性贬值压力可能随之加大，而这又可能成为央行货币政策新的制约因素。

尽管市场在超跌后出现幅度较大的反弹，但从两市成交量和融资余额等数据来看，市场偏向谨慎的心态依旧较为明显，投资者对于市场格局的认识呈现出更为理性的特征。考虑到资金动能不足，短期政策面亦难以出现新的利好，尽管超跌后出现短暂反弹的可能性难以排除，但预计整体市场格局仍将延续偏弱的态势，在此过程中，博反弹的风险和操作难度仍较大。



东吴动态

“熔断”时代 东吴安盈基金凸显量化优势

1月8日 北京晨报

新年的第一个交易日，沪深300指数先后达到熔断阈值触发“熔断”。市场分析人士认为，“熔断”机制被触发或成为市场常态。

据悉，1月4日-1月22日，东吴安盈量化灵活配置混合型基金正在发行中，该基金独特的量化策略设计，更为契合窄幅震荡行情。

展望2016年，东吴基金分析人士认为，稳增长、宽松的流动性和转型的大背景，为成长股投资提供了较好的市场环境。

谋求稳定收益 东吴安盈量化基金正式发行

1月4日 金融投资报

东吴安盈量化灵活配置混合型基金于1月4日-1月22日期间正式发行，投资者可通过交通银行各网点以及券商、第三方等代销渠道、东吴基金官网直销平台认购。

据了解，与普通的主动管理型基金相比，引入量化策略后的东吴安盈量化基金具有三大明显优势：其一，严格止损，下跌时回撤小；其二，择优建仓，上涨时不掉队；其三，量化选股，配置强势子行业。东吴安盈量化基金的量化策略具有“独创性”，其不采用股指期货对冲，而是通过买入、止盈、止损等择时机制和多因子选股模型优化收益，既能在震荡市或牛市中及时捕获盈利机会，也能在市场出现系统性风险时，利用严格的择时止损机制规避风险。相对而言，回撤更小、收益也更稳定。

展望2016年，东吴基金相关人士表示，资金对权益资产的配置需求将稳步提升，再叠加供给侧等改革不断推进、落地，将会逐渐提升市场风险偏好，尤其是上半年，股市有望在相对有利的条件下呈现震荡向上格局。

政策再迎利好 东吴国企改革基金跨年布局

12月18日 金融投资报

随着近期中央经济工作会议召开，国企改革有望成为2016年度重要议题之一，而近期将有10份



东吴动态

国企改革文件密集出台，改革落地速度正在加快。东吴国企改革主题灵活配置混合型基金（002159）于12月3日至12月23日，正在发行中，新基金有望为投资者掘得2016年“第一桶金”。

据了解，从资产配置来看，该基金主要投资于国企改革主题的上市公司，除覆盖具有改革预期的国有上市公司之外，还将延伸到其它受益的民营上市公司，特别是优质成长股龙头企业；从投资策略来看，该基金引入了量化策略进行择时和选股，尤其是其择时止损机制，可在市场出现系统性风险时，果断离场转投固定收益类资产，锁定绝大部分收益。

展望2016年，东吴基金表示，随着市场情绪好转以及改革推进力度的加大，国企改革的投资逻辑将从预期推动转变为红利驱动，其中业务红利短期即可爆发，而制度红利可长期释放。投资者可提前布局，掘金新一年的国企改革投资的主旋律。



常见问题

问：目前的电子服务类型有哪些？

答：本基金公司的客户均享有信息订制的免费服务，投资者通过客服热线或网站“账户查询”进行信息补全并订阅。目前有以下服务供客户选择：

- 1) 主动推送类服务：交易确认、账户确认、东吴观点、生日祝福、节日祝福、活动公告、产品推荐，营销资讯等的短信和邮件服务。
- 2) 订制短信：持有基金日、周净值短信。
- 3) 订制邮件：持有基金日、周净值公告，东吴旗下所有基金周、日净值公告，对账单，投资研究周报，东吴基金晨报等。
- 4) 年度纸质对账单寄送服务。

问：如何更改邮寄地址或其他联系方式？

答：无论您是直销还是代销客户，都可以通过以下方式修改联系方式：

- 1) 邮寄：填写东吴基金客户对账单上“更改地址回执”，邮寄至：上海市浦东新区源深路 279 号东吴基金管理有限公司客户服务中心，邮编：200135。
- 2) 传真：将填妥的“更改地址回执”传真至：021-50509884。
- 3) 电话：拨打东吴基金客户服务热线 400-821-0588（免长途费）或 021-50509666 按 0 转人工服务，由客服人员为您修改。
- 4) 邮件：发送修改申请至东吴基金客服邮箱 services@scfund.com.cn 进行修改。

问：新基金何时可以查到认购结果？

答：销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，仅代表销售机构确实接受了客户认购申请的委托提交，申请的成功与否应以基金注册登记机构的确认结果为准。投资者在基金成立日 2 个工作日后可以通过东吴基金网站的账户管理查询认购份额，或通过原代销机构网点打印认购确认单。