

# 东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金 基金产品资料概要

编制日期：2020年8月26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	东吴智慧医疗量化混合	基金代码	002919
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	2016-08-11	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	开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	赵梅玲	开始担任本基金基金经理的日期	2020-07-23
		证券从业日期	2007-07-23
<b>其他</b>			

## 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	本基金主要投资于智慧医疗主题相关股票，通过量化选股与择时相结合的方法，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。
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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、权证、债券（包括但不限于国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、公司债、中期票据、可转换债券（含分离型可转换债券）、次级债）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具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。
主要投资策略	基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；投资于智慧医疗主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；权证投资比例不得超过基金资产净值的 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；本基金投资于其他工具的比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

## 2、智慧医疗主题相关公司的界定

本基金定义的智慧医疗主题相关公司主要包括三大类：1) 医药医疗产业链上的公司，以产品创新、技术创新、模式创新、体制机制创新等手段(包括丰富的药品器械产品梯队、创新药、智能硬件与软件信息化、医药电商、医保管理、民营医疗机构等)，服务国民的医疗健康事业；2) 非医药医疗领域的公司，以先进的产品、技术或者商业模式，为医药医疗产业链提供重要的补充和服务(如硬件制造、软件及信息系统开发、中间产品供应等)；3) 非医药医疗领域的但有向医药医疗领域转型预期的公司。

## 3、股票投资策略

(1) 个股精选

(2) 股票择时策略

本基金通过对智慧医疗股票池中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，以此确定建仓时机。根据均线系统理论、相对强弱理论等形成具客观性、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，避免了传统投资决策择时过程中主观非理性的干扰因素。当量化决策系统判断系统性风险较大时，本基金可以降低股票仓位，转投固定收益，从而控制回撤；当行情出现反转，再买入信号出现后，本基金通过再入场机制迅速完成加仓，获取收益；

## 4、债券投资策略

## 5、资产支持证券投资策略

## 6、股指期货投资策略

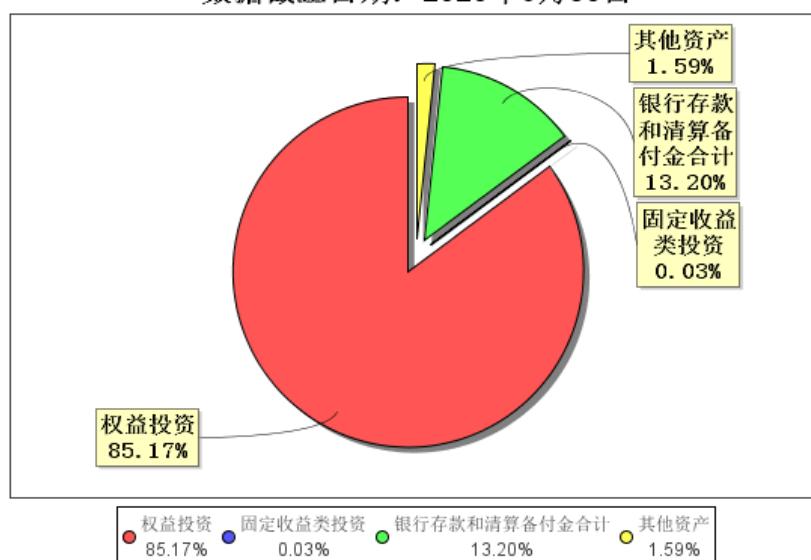
## 7、权证投资策略

**业绩比较基准**  $65\% \times \text{中证医疗指数收益率} + 35\% \times \text{中债综合全价(总值)指数收益率}$

**风险收益特征** 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。

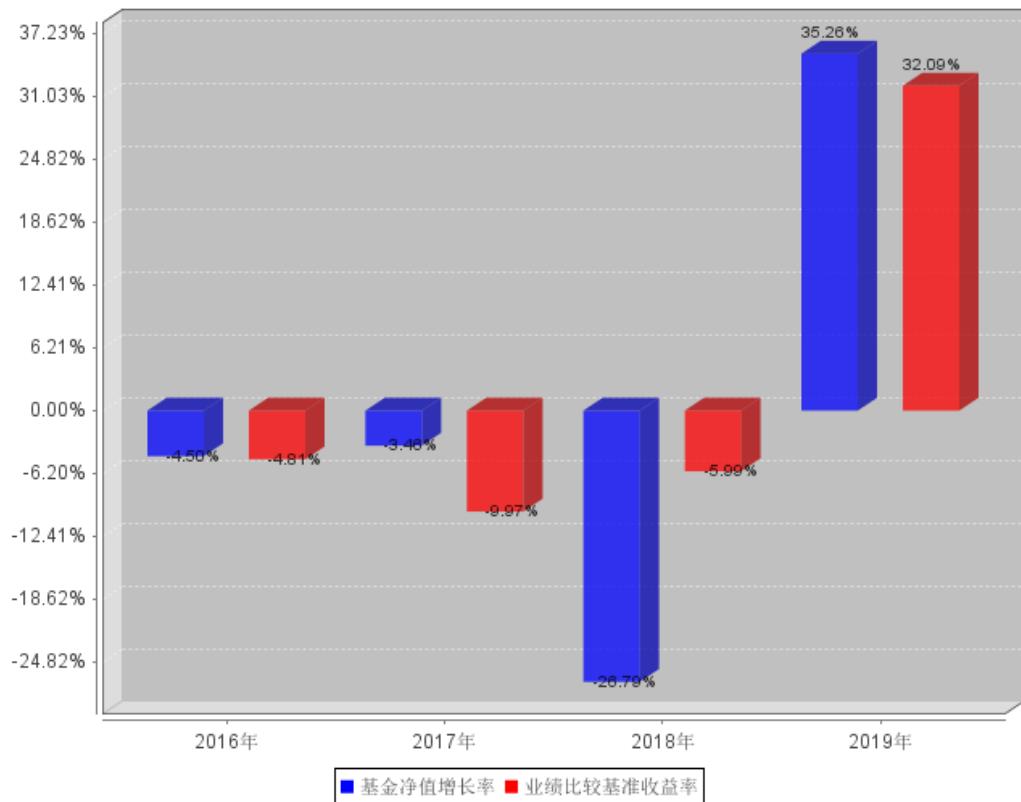
## (二) 投资组合资产配置图表

投资组合资产配置图表  
数据截止日期：2020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



## 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	1.50%	
	100 万 ≤ M < 200 万	1.20%	
	200 万 ≤ M < 500 万	0.80%	
	500 万 ≤ M < 1000 万	0.30%	
	M ≥ 1000 万	1000 元/笔	
赎回费	N < 7 天	1.50%	
	7 天 ≤ N < 30 天	0.75%	
	30 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	1.50%
托管费	0.25%
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：**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、职业道德风险、流动性风险、合规性风险、投资管理风险及其他风险等。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会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。

## 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