# 东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告

2020年12月31日

基金管理人: 东吴基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期:二〇二一年一月二十一日

# §1 重要提示

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2021 年 1 月 19 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。

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。 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

# § 2 基金产品概况

基金简称	东吴多策略混合
基金主代码	580009
交易代码	580009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月13日
报告期末基金份额总额	17, 645, 208. 47 份
	本基金在充分控制基金资产风险的前提下,通过积极
投资目标	主动的资产配置和多种策略,充分挖掘市场中的投资
	机会,力争实现基金资产的长期稳定增值。
	本基金依托行业研究和金融工程团队,采用"自上而
	下"资产配置和"自下而上"精选个股相结合的投资
	策略。本基金通过对宏观经济运行态势、宏观经济政
	策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况进行
投资策略	研判,结合考虑相关类别资产的收益风险特征,采用
	定量与定性相结合的方法动态的调整股票、债券、现
	金等大类资产的配置,并积极参与新股申购,辅助权
	证及其他金融工具等投资,控制基金组合的投资风
	险,力争实现基金资产的长期稳定增值。
小好生以拉甘州	本基金业绩比较基准为: 沪深 300 指数收益率*50%+
业绩比较基准	中国债券综合全价指数收益率*50%。
	本基金为混合型证券投资基金, 其预期收益和风险高
可及此关柱尔	于货币市场基金、债券型基金, 而低于股票型基金,
风险收益特征	属于证券投资基金中的中高风险、中高预期收益品
	种。
基金管理人	东吴基金管理有限公司

基金托管人	交通银行股份有限公司
	Zewi wu ii wa i

# §3 主要财务指标和基金净值表现

# 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2020年10月1日 - 2020年12月31日)
1. 本期已实现收益	4, 159, 767. 05
2. 本期利润	5, 639, 366. 26
3. 加权平均基金份额本期利润	0.3303
4. 期末基金资产净值	32, 937, 189. 48
5. 期末基金份额净值	1.8666

- 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。

# 3.2 基金净值表现

# 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率	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
过去三个月	21. 24%	1.52%	7. 12%	0. 50%	14. 12%	1.02%
过去六个月	30. 04%	1.56%	12. 15%	0. 66%	17.89%	0.90%
过去一年	57. 80%	1.49%	13. 57%	0. 70%	44. 23%	0. 79%
过去三年	85. 57%	1.33%	17. 69%	0. 66%	67.88%	0. 67%
自基金合同 生效起至今	88. 17%	1.31%	17. 96%	0. 66%	70. 21%	0. 65%

- 注: 1. 比较基准=沪深 300 指数收益率\*50%+中国债券综合全价指数收益率\*50%
  - 2. 本基金转型日为 2017 年 12 月 13 日。

# 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率 变动的比较





注: 1. 比较基准=沪深 300 指数收益率\*50%+中国债券综合全价指数收益率\*50%

2. 本基金转型日为 2017 年 12 月 13 日。

# § 4 管理人报告

# 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
<b>姓石</b>	小分	任职日期	离任日期	<b>业分外业中</b> 限	<u> </u>
刘瑞	基金经理	2018年11月20日	2020 年 12 月 16 日	7年	刘瑞先生,中国国籍, 美国哥伦比亚大学计 算机科学与技术硕 士,具备证券投资基 金从业资格。曾任职 国泰君安期货投资经 理助理;上海陆宝投

					资管理有限公司投资
					经理; 嘉实基金管理
					有限公司策略研究
					员。2018年1月加入
					东吴基金管理有限公
					司,现任基金经理。
					2018年11月20日至
					2020年12月16日担
					任东吴多策略灵活配
					置混合型证券投资基
					金基金经理,2018年
					11月20日至2020年
					12月16日担任东吴安
					享量化灵活配置混合
					型证券投资基金基金
					经理, 2018年3月8
					日至今担任东吴新产
					业精选股票型证券投
					资基金(原东吴新产
					业精选混合型证券投
					资基金)基金经理,
					2019年4月29日至今
					担任东吴阿尔法灵活
					配置混合型证券投资
					基金基金经理。
					周健先生,中国国籍,
					南开大学经济学硕
					士,具备证券投资基
					金从业资格。曾任职
					海通证券股份有限公
					司研究所金融工程分
					析师。2011年5月加
					入东吴基金管理有限
					公司,现任基金经理。
		2020年12月			2012年10月27日至
周健	基金经理	16日	_	14年	2015年5月29日担任
		10 日			东吴新创业股票型证
					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, 2016 年 2 月 3
					日至 2017 年 4 月 19

日担任东吴安盈量化 灵活配基金经理 2012 年 5 月 03 日 至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 1 月 18 日至今担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金基金基金经理, 2013 年 6 月 5 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 1 月 18 日至今担任东吴河泽 300 指数型证吴河证 100 指数增强证券投资基金(LOF))基金经理, 2016 年 2 月 5 日至 2017 年 4 月 19 日及 2019 年 5 月 30 日至今担任东吴国置混合型证券投资基金基金经理, 2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 12 月 13 日及 2020 年 12 月 16 日至 2018 年 2 月 16 日至 2018 年 3 年 2 年 3 年 3 年 3 年 3 年 3 年 3 年 3 年 3			
投资基金基金经理, 2012 年 5 月 03 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 1 月 18 日至今担任东吴中市资长基本基金经理, 2013 年 6 月 5 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 1 月 18 日至今担任东吴护深 300 指数型型证券投资基金(105))基金经理, 2016 年 2 月 5 日至 2017 年 4 月 19 日及 2019 年 5 月 30 日至今担任东吴南爱中进任东吴南爱中进任东吴南亚市营业,2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今担任东吴安鑫基化灵活配置基金经理, 2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今担任东吴安鑫世灵活配置基金经理, 2020 年 12 月 16 日至今担任东吴安海市营业营业营业营业营业营业营业营业营业营业营业营业营业营业营业营业营业营业营业			日担任东吴安盈量化
2012 年 5 月 03 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 1 月 18 日至今 担任东吴中证新为投资基金基金经理、2013 年 6 月 5 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 1 月 18 日至今担任东吴神深 300 指数更未 2%证券投资基金(100) 基金经理,2016 年 2 月 5 日至 2017 年 4 月 19 日及 2019 年 5 月 30 日至今担任东民置混合型证券投资基金基金经理,2016 年 6 月 3 日至今担任所配置混合型证券投资基金基金经理,2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今担任东吴应证券投资基金基企是,2020 年 7 月 26 日至今担任东吴应证券投资基金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴应证券投资基金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴和证券投资基金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴和征军吴和征军公司,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴和征军公司,2020 年 12 月 16 日至今基本公司,2020 年 12 月 16 日至今日本公司,2020 年 12 月 16 日至年本公司,2020 年 12 月 16 日至年本公司,2020 年 12 月 16 日至今日本公司,2020 年 12 月 16 日至今日本公司,2020 年 12 月 16 日至 12 月 12 日本公司,2020 年 12 月 16 日本公司,2020 年 12 月 16 日本公司,2020 年 12 月 16 日本公司,2020 年 12 月 12 日本公司,2020 年 12 月 16 日本公司,2020 年 12 月 12 月 16 日本公司,2020 年 12 月 12 月 12 日本公司,2020 年 12 月 12 月 12 日本公司,2020 年 12 月 12 月 12 月 12 日本公司,2020 年 12 月 12 日本公司,2020 年 12 月 12 日本公司,2020 年 12 月 12 日本公司,2020 年 12 月 12 月 12 日本公司,2020 年 12 月 12 月 12 日本公司,2020 日本公司,2020 日			灵活配置混合型证券
2018年12月13日及2020年1月18日至今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日及2020年1月18日至今担任东吴沪深300指数型证券投资基金(原东吴深证100指数增强型证券投资基金(原东吴深证100指数增强型证券投资基金(10F))基金经理,2016年2月5日至2017年4月19日及2019年5月30日至今担任东吴国企改革主题灵活适金基金经理,2016年6月3日至2018年12月13日及2020年7月23日至今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,2020年12月16日至今担任东吴专赛略灵活配置混合型证券投资基金经理,2020年12月16日至今担任东吴配置混合型证券投资基金经理,2020年12月16日至今担任东吴配置、2020年12月16日至今担任东吴配置、2020年12月16日至今担任东吴配置、2020年12月16日至今担任东吴配置、2020年12月16日至今担任东吴配置、2020年12月16日至今担任东吴配置、2020年12月16日至今担任东吴配置、2020年12月16日至今担任东吴配置、2020年12月16日至今担任东吴配置、2020年12月16日至今担任东吴配置、2020年12月16日至今担任东吴配置、2020年12月16日至今担任东吴配置、2020年12月16日至秦县经			投资基金基金经理,
2020年1月18日至今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日及2020年1月18日至今担任东吴沪深300指数型证券投资基金(原东吴深证100指数增强型证券投资基金(原东吴深证100指数增强型证券投资基金(原东吴国企改革主题灵行等5月30日至今担任东吴国企改革主题规查数理,2016年6月3日至2018年12月13日及2020年7月23日至今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,2020年12月16日至今担任东吴安徽是公司年12月16日至今担任东吴安徽是公司年12月16日至今担任东吴都镇略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经			2012 年 5 月 03 日至
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 日及 2020 年 1 月 18 日至今担任东吴沪深 300 指数型证券投资基金(原东吴荥证 100 指数增强证券投资基金(原东吴邓证 100 指数增强证券投资基金(LOF))基金经理,2016 年 2 月 5 日至 2017 年 4 月 19 日及 2019 年 5 月 30 日至今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,2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今担任东吴安鑫量化灵活配置。启型证券投资基金基金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴安徽军元活配是全型证券投资基金基金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴和证券投资基金基金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴配置化化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴配置化化灵活配置混合型证券投资基金基金经			2018年12月13日及
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 日及 2020 年 1 月 18 日至今担任东吴沪深 300 指数型证券投资基金(原东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(原东吴深证 100 指数增强型证券投资基。(10F))基金经理,2016 年 2 月 5 日至 2017 年 4 月 19 日及 2019 年 5 月 30 日至今担任东吴国企改革主题灵灵资基金基金经理,2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今担任东吴安鑫量化灵资基金基金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴安徽灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴金、黄岭灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴配置代化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020 年 12 月 16			2020年1月18日至今
基金经理, 2013 年 6 月 5 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 1 月 18 日至今担任东吴 沪深 300 指数型证券 投资基金(原东吴深 证 100 指数增强型证 券投资基金(原东吴深 证 100 指数增强型证 券投资基金(10F)) 基金经理, 2016 年 2 月 5 日至 2017 年 4 月 19 日及 2019 年 5 月 30 日至今担任东吴国 企改革主题灵活配置 混合型证券投资基金 基金经理, 2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今担任东吴 安鑫量化灵资基金基 金经理, 2020 年 12 月 16 日至今担任东吴 安徽建、2020 年 12 月 16 日至今担任东吴和 策投资基金基金经理, 2020 年 12 月 16 日至今担任东吴和 董宗活配置沿 公理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴配置 优化灵活配量混合型 证券投资基金基金经 理, 2020 年 12 月 16			担任东吴中证新兴产
月5日至2018年12月13日及2020年1月18日至今担任东吴沪深300指数型证券投资基金(原东吴深证100指数增强型证券投资基金(原东吴深证100指数增强型证券投资基金(LOF))基金经理,2016年2月5日至2017年4月19日及2019年5月30日至今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,2016年6月3日至2018年12月13日及2020年7月23日至2018年12月13日及2020年7月23日至2018年12月16日至今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,2020年12月16日至今担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴和武置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴和武置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴配置			业指数证券投资基金
月 13 日及 2020 年 1 月 18 日至今担任东吴沪深 300 指数型证券投资基金(原东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF))基金经理, 2016 年 2 月 5 日至 2017 年 4 月 19 日及 2019 年 5 月 30 日至今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, 2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今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, 2020 年 12 月 16 日至今担任东吴安徽略灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 12 月 16 日至今担任东吴和任东吴和代苏民国混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 12 月 16 日至今担任东吴和代元武配置混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 12 月 16 日至今担任东吴和代元武配置混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 12 月 16 日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 12 月 16			基金经理, 2013 年 6
月18日至今担任东吴沪深 300 指数型证券投资基金(原东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(原东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF))基金经理,2016 年 2 月 5 日至 2017 年 4 月 19 日及 2019 年 5 月 30 日至今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,2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今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,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴和联省代化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020 年 12 月 16			月 5 日至 2018 年 12
沪深 300 指数型证券 投资基金(原东吴深 证 100 指数增强型证 券投资基金(LOF)) 基金经理, 2016 年 2 月 5 日至 2017 年 4 月 19 日及 2019 年 5 月 30 日至今担任东吴国 企改革主题灵活配置 混合型证券投资基金 基金经理, 2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今担任东吴 安鑫量化灵活配置混 合型证券投资基金基 金经理, 2020 年 12 月 16 日至今担任东吴多 策略灵活配置混合型 证券投资基金基金经 理, 2020 年 12 月 16 日至今担任东吴配置 优化灵活配置混合型 证券投资基金基金经 理, 2020 年 12 月 16			月 13 日及 2020 年 1
投资基金(原东吴深证 100 指数增强型证券投资基金(LOF))基金经理,2016 年 2 月 5 日至 2017 年 4 月 19 日及 2019 年 5 月 30 日至今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,2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今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,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴和广东吴和广东吴和广东吴和广东吴和广东吴和广东吴和广东吴和广东吴和广东吴和广			月 18 日至今担任东吴
证 100 指数增强型证券投资基金(LOF))基金经理,2016 年 2月5日至 2017 年 4月19日及 2019 年 5月30日至今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,2016 年 6月3日至 2018 年 12月13日及 2020 年 7月23日至今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,2020 年 12月16日至今担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020 年 12月16日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020 年 12月16日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020 年 12月16日至今担任东吴配置			沪深 300 指数型证券
券投资基金(LOF)) 基金经理,2016 年 2 月 5 日至 2017 年 4 月 19 日及 2019 年 5 月 30 日至今担任东吴国 企改革主题灵活配置 混合型证券投资基金 基金经理,2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今担任东吴 安鑫量化灵活配置混 合型证券投资基金基 金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴多 策略灵活配置混合型 证券投资基金基金经 理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴配置 优化灵活配置混合型 证券投资基金基金经			投资基金(原东吴深
基金经理,2016年2月5日至2017年4月19日及2019年5月30日至今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,2016年6月3日至2018年12月13日及2020年7月23日至今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,2020年12月16日至今担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经			证 100 指数增强型证
月5日至2017年4月19日及2019年5月30日至今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,2016年6月3日至2018年12月13日及2020年7月23日至今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,2020年12月16日至今担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经证券投资基金基金经			券投资基金(LOF))
19 日及 2019 年 5 月 30 日至今担任东吴国 企改革主题灵活配置 混合型证券投资基金 基金经理,2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今担任东吴 安鑫量化灵活配置混 合型证券投资基金基 金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴多 策略灵活配置混合型 证券投资基金基金经 理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴配置 优化灵活配置混合型 证券投资基金基金经 证券投资基金基金经			基金经理, 2016 年 2
30 日至今担任东吴国 企改革主题灵活配置 混合型证券投资基金 基金经理,2016 年 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今担任东吴 安鑫量化灵活配置混 合型证券投资基金基 金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴多 策略灵活配置混合型 证券投资基金基金经 理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴配置 优化灵活配置混合型 证券投资基金基金经			月5日至2017年4月
企改革主题灵活配置 混合型证券投资基金 基金经理,2016年6 月3日至2018年12 月13日及2020年7 月23日至今担任东吴 安鑫量化灵活配置混 合型证券投资基金基 金经理,2020年12月 16日至今担任东吴多 策略灵活配置混合型 证券投资基金基金经 理,2020年12月16 日至今担任东吴配置 优化灵活配置混合型 证券投资基金基金经			19 日及 2019 年 5 月
混合型证券投资基金基金经理,2016年6月3日至2018年12月13日及2020年7月23日至今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,2020年12月16日至今担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经			30 日至今担任东吴国
基金经理,2016年6月3日至2018年12月13日及2020年7月23日至今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,2020年12月16日至今担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经证券投资基金基金经			企改革主题灵活配置
月3日至2018年12月13日及2020年7月23日至今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,2020年12月16日至今担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经证券投资基金基金经			混合型证券投资基金
月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今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,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经证券投资基金基金经			基金经理, 2016 年 6
月23日至今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,2020年12月16日至今担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经证券投资基金基金经			月 3 日至 2018 年 12
安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经证券投资基金基金经			月 13 日及 2020 年 7
合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经证券投资基金基金经			月23日至今担任东吴
金经理,2020年12月 16日至今担任东吴多 策略灵活配置混合型 证券投资基金基金经 理,2020年12月16 日至今担任东吴配置 优化灵活配置混合型 证券投资基金基金经			安鑫量化灵活配置混
16 日至今担任东吴多 策略灵活配置混合型 证券投资基金基金经 理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴配置 优化灵活配置混合型 证券投资基金基金经			合型证券投资基金基
策略灵活配置混合型 证券投资基金基金经 理,2020年12月16 日至今担任东吴配置 优化灵活配置混合型 证券投资基金基金经			金经理,2020年12月
证券投资基金基金经理,2020年12月16 日至今担任东吴配置 优化灵活配置混合型 证券投资基金基金经			16 日至今担任东吴多
理,2020年12月16日至今担任东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金经			策略灵活配置混合型
日至今担任东吴配置 优化灵活配置混合型 证券投资基金基金经			证券投资基金基金经
优化灵活配置混合型 证券投资基金基金经			理, 2020年12月16
证券投资基金基金经			日至今担任东吴配置
			优化灵活配置混合型
理。			证券投资基金基金经
			理。

- 注: 1、此处的任职日期及离职日期为公司对外公告之日。
  - 2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》相关规定。

# 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期末无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

# 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的 第 6 页 共 13 页 规定及其他有关法律规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,为基金持有人 谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人按照法律法规关于公平交易的相关规定,严格执行公司公平交易管理制度,加强了对所管理的不同投资组合同向交易价差的分析,确保公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。

## 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度,国内经济出现部分过热迹象。虽然国外疫情有所反复,但随着疫苗逐步普及,北半球季节影响消除,全球经济复苏趋势中止的可能性较低。国内复苏已经进展到上游,PMI 原材料购进价格指数升至近五年高点,同时房地产交易明显活跃。

股市方面,市场进入到"流动性趋稳+经济持续修复"组合。四季度市场开始预期货币政策转向,高估值个股在11月份出现快速回调,而12月高景气板块的拉升又再度提高市场情绪。

报告期内,本基金加大对军工行业配置比重,核心原因是在行业框架比较下,军工行业投资吸引力显著增强。四季度以来,军工行业景气度趋势持续向好,行业迎来科研成果的放量转换期,十四五期间行业增速也有望持续上行,企业盈利复合增速预计也将逐步加速,同时行业逆周期属性导致行业及企业盈利增速确定性强。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.8666 元;本报告期基金份额净值增长率为 21.24%,业 绩比较基准收益率为 7.12%。

## 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,因赎回等原因,本基金于 2020 年 10 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形,已上报中国证监会,公司正在完善相关应对方案。 本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

# § 5 投资组合报告

# 5.1 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	30, 030, 283. 11	90. 34
	其中: 股票	30, 030, 283. 11	90. 34
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	3, 138, 348. 57	9. 44
8	其他资产	72, 324. 47	0. 22
9	合计	33, 240, 956. 15	100.00

# 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

# 5.2.1 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		_
В	采矿业	1	_
С	制造业	30, 022, 519. 53	91. 15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应 业	1	-
Е	建筑业		_
F	批发和零售业		_
G	交通运输、仓储和邮政业		_
Н	住宿和餐饮业		_
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7, 763. 58	0. 02
J	金融业	_	-
K	房地产业	_	-
L	租赁和商务服务业	_	_
M	科学研究和技术服务业	_	_
N	水利、环境和公共设施管理业		_
0	居民服务、修理和其他服务业	-	_
Р	教育	-	_

Q	卫生和社会工作	_	_
R	文化、体育和娱乐业	_	-
S	综合	_	-
	合计	30, 030, 283. 11	91. 17

#### 5.2.2 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。

# 5.3 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

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	688122	西部超导	24, 745	1, 967, 474. 95	5. 97
2	600893	航发动力	30, 100	1, 786, 435. 00	5. 42
3	603678	火炬电子	24, 100	1, 742, 430. 00	5. 29
4	600316	洪都航空	29, 600	1, 683, 352. 00	5. 11
5	002389	航天彩虹	47, 200	1, 569, 400. 00	4. 76
6	300395	菲利华	26, 200	1, 567, 546. 00	4. 76
7	300726	宏达电子	21, 500	1, 555, 525. 00	4. 72
8	002179	中航光电	19, 660	1, 539, 181. 40	4. 67
9	603267	鸿远电子	11, 900	1, 532, 244. 00	4. 65
10	600862	中航高科	50, 500	1, 520, 050. 00	4. 61

### 5.4 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。

- **5.5 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。
- 5.6 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。

- **5.7 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。
- **5.8 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。
- 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
- 5.9.1 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。

#### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

# 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

# 5.10.2 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。

# 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

#### 5.11.1 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,或在报告编制目前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

# 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	25, 000. 42
2	应收证券清算款	_
3	应收股利	_
4	应收利息	552. 26
5	应收申购款	46, 771. 79
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	72, 324. 47

# 5.11.4 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。

#### 5.11.5 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。

#### 5.11.6 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。

# § 6 开放式基金份额变动

单位: 份

报告期期初基金份额总额	17, 497, 771. 93
报告期期间基金总申购份额	904, 884. 78
减:报告期期间基金总赎回份额	757, 448. 24
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"	
填列)	_
报告期期末基金份额总额	17, 645, 208. 47

- 注: 1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务;
  - 2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务。

# § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

# 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未持有本基金份额。

# 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期间无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

# §8 影响投资者决策的其他重要信息

# 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
投资者 类别	序号	持有基金份额 比例达到或者 超过 20%的时间 区间	期初 份额	申购份额	赎回 份额	持有份额	份额占比
机构	1	20201001 – 20201231	13, 603, 802. 99	0.00	0. 00	13, 603, 802. 99	77. 10%
个人	-	-	-		_	-	-

产品特有风险

#### 1. 巨额赎回风险

- (1)本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大,单一投资者的巨额赎回,可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响;
- (2)单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时,在符合基金合同约定情况下,如基金管理人认为有必要,可延期办理本基金的赎回申请,投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险;如果连续2个开放日以上(含)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;
- 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险

单一投资者巨额赎回后,若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的,基金管理人应当向中国证监会提出解决方案,或按基金合同约定,转换运作方式或 终止基金合同,其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险:

3. 流动性风险

单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险:

4. 巨额赎回可能导致基金资产规模过小,导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

# 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

# § 9 备查文件目录

# 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准东吴内需增长混合型证券投资基金设立的文件;
- 2、《东吴内需增长混合型证券投资基金基金合同》;
- 3、《东吴内需增长混合型证券投资基金托管协议》;
- 4、《东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》:
- 5、《东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;
- 7、报告期内东吴多策略灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

# 9.2 存放地点

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处;其余备查文件存放在基金管理人处。

#### 9.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅。 第 12 页 共 13 页 网站: http://www.scfund.com.cn

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人东吴基金管理有限公司。

客户服务中心电话 (021) 50509666 / 400-821-0588

东吴基金管理有限公司 2021年1月21日