## 东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金 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: 中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:二〇二一年一月二十二日

## §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。

基金托管人中国农业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       | 东吴配置优化混合                     |
|------------|------------------------------|
| 基金主代码      | 582003                       |
| 交易代码       | 582003                       |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                       |
| 基金合同生效日    | 2017 年 12 月 25 日             |
| 报告期末基金份额总额 | 9, 342, 889. 90 份            |
|            | 本基金根据不同市场情况变化,对股票、债券及其他      |
| 投资目标       | 投资品种的配置进行优化调整,追求基金资产长期稳      |
|            | 定增值 。                        |
| 投资策略       | 本基金在严格风险控制的基础上,追求稳健收益。       |
| 小小生儿龙节冰    | 沪深 300 指数收益率*50%+中国债券综合全价指数收 |
| 业绩比较基准<br> | 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      |
| 风险收益特征     | 于货币市场基金、债券型基金, 而低于股票型基金,     |
|            | 属于证券投资基金中的中高风险品种。            |
| 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                 |

## §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      | 3, 202, 543. 07               |
| 2. 本期利润         | 1, 540, 871. 48               |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 1852                       |
| 4. 期末基金资产净值     | 15, 687, 787. 09              |
| 5. 期末基金份额净值     | 1. 6791                       |

- 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<br>收益率标准差<br>④ | 1)-3    | 2-4    |
|----------------|---------|------------|------------|-----------------------|---------|--------|
| 过去三个月          | 11.78%  | 0.91%      | 7. 12%     | 0. 50%                | 4. 66%  | 0.41%  |
| 过去六个月          | 18.66%  | 1.32%      | 12. 15%    | 0. 66%                | 6. 51%  | 0.66%  |
| 过去一年           | 38. 35% | 1.24%      | 13. 57%    | 0. 70%                | 24. 78% | 0. 54% |
| 过去三年           | 41.83%  | 1.32%      | 17. 69%    | 0. 66%                | 24. 14% | 0.66%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 41. 34% | 1.31%      | 17. 32%    | 0. 66%                | 24. 02% | 0. 65% |

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

## 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、业绩比较基准=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 25 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  |
|-----|------------|-------------|------|-----------------|---|
| 姓石  | <b>叭</b> 旁 | 任职日期        | 离任日期 | <b>证分</b> /火业牛队 | 5亿·97   |
| 赵梅玲 | 基金经理       | 2020年4月1日   | _    | 13 年            | 赵梅玲女士,中国国籍,武汉大学经济学硕士,具备证券投资基金从业资格。曾任职安信证券股份有限公司行业分析师。 |

第 4 页 共 13 页

|          |          |          |          |      | 2012 年 7 月加入东吴                        |
|----------|----------|----------|----------|------|---------------------------------------|
|          |          |          |          |      | 基金管理有限公司,                             |
|          |          |          |          |      | 现任基金经理。2016                           |
|          |          |          |          |      | 年 5 月 10 日至 2018                      |
|          |          |          |          |      | 年4月19日担任东吴                            |
|          |          |          |          |      | 配置优化灵活配置混                             |
|          |          |          |          |      | 合型证券投资基金                              |
|          |          |          |          |      |                                       |
|          |          |          |          |      | (原东吴配置优化混                             |
|          |          |          |          |      | 合型证券投资基金)                             |
|          |          |          |          |      | 基金经理,2018年3                           |
|          |          |          |          |      | 月12日至今担任东吴                            |
|          |          |          |          |      | 进取策略灵活配置混                             |
|          |          |          |          |      | 合型开放式证券投资                             |
|          |          |          |          |      | 基金基金经理,2020                           |
|          |          |          |          |      | 年4月1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                           |
|          |          |          |          |      | 7月23日至今担任东                            |
|          |          |          |          |      | 吴价值成长双动力混                             |
|          |          |          |          |      | 合型证券投资基金基                             |
|          |          |          |          |      | 金经理,2020年7月                           |
|          |          |          |          |      | 23 日至今担任东吴智                           |
|          |          |          |          |      | 慧医疗量化策略灵活<br>配置混合型证券投资                |
|          |          |          |          |      | 基金基金经理。                               |
|          |          |          |          |      | 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型 |
|          |          |          |          |      | 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。                            |
| <br>  周健 | 基金经理     | 2020年12月 | _        | 14 年 | 2012年10月27日至                          |
| / C4 IA- | 工业工工     | 16 日     |          | ** 1 | 2015年5月29日担任                          |
|          |          |          |          |      | 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                      |
| L        | <u> </u> | <u> </u> | <u> </u> |      | , = , 4 9                             |

| 日至2017年4月19日担任东吴安益量化 灵活配置混合型证券 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 担任东吴中证新发投资基金 基金经理,2013年6 月5日至2018年12月13日及2020年1 月18日至今和任东吴沪深 300指数型证券 投资基金(原东强型证券 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日至今担任东吴配灵和资业要决资基金(是少担任东吴配灵和资业。2016年2月13日至2018年12月13日及2020年7月23日至今担任底是高企业证券投资基金基金经理。2020年7月23日至今担任东吴配金经理。2020年12月16日至今担任东吴电量证券投资基金基金经理。2020年12月16日至今担任东吴电量证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴和宣代化农吴和宣传东吴和宣传东吴和宣传东吴和宣传东吴和宣传东吴和宣传东吴和宣传东吴和宣传东  |  |  |                  |
|---|--|--|------------------|
| 灵活配置混合型证券<br>投资基金基金经理,<br>2012年5月03日至<br>2020年1月18日至今<br>担任东吴中证新兴基金<br>基金经理,2013年6<br>月5日至2018年12<br>月13日及2020年1<br>月13日及2020年1<br>月18日至今担任东吴<br>淀深300指数型证券<br>投资基金(L0F))<br>基金经理,2016年2<br>月5日至2017年4月<br>19日及2019年5月<br>30日至今担任东吴国<br>電合型证券投资基金<br>基金经理,2016年1<br>月3日至今担任东吴国<br>電合型证券投资基金基金经<br>更2018年12月<br>月3日至今担任东吴<br>安鑫量化灵活配基<br>合型证券2020年7<br>月23日至今担任东吴<br>安鑫量、2020年7<br>月23日至今担任东吴<br>安鑫量、2020年12月<br>16日至今担任东吴<br>策略灵活配置混合型<br>证券投资基金基金经<br>理,2020年12月16日至今担任东吴<br>发产型证券投资基金经<br>理,2020年12月16日至今担任东吴   |  |  | 日至 2017 年 4 月 19 |
| 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 350 指数型证券投资基金(LOF))基金经理, 2016 年 2 月 5 日至 2017 年 4 月 19 日及 2019 年 5 月 30 日至今担任东吴国置金改革主题灵法强金经理, 2016 年 6 月 3 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 日至今担任配置混合型证券投资基金基金经理, 2020 年 7 月 26 日至今担任东吴安鑫市灵区宣报。   |  |  | 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 担任东吴中证新光产业指数证典,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 经资基金(原本型 2016 年 2 月 5 日至 2017 年 4 月 19 日及 2019 年 5 月 30 日至今担任 6 月 3 日至 2018 年 12 月 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今担任 13 日及 2020 年 7 月 23 日至今担任 13 日交 2020 年 7 月 23 日至今担任 12 月 16 日至今担任 16 日至今担任 16 日至今担任 17 月 18 日 17 日 18 日 18 日 18 日 18 日 18 日 18 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12月13日及2020年12月13日及2020年2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(原东吴军证 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灵资基金基金经理,2016年6月3日至今担任东吴国企改革至2018年12月13日及2020年7月23日至今担任东吴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设定,2020年12月16日至今担任东吴配置现分投资基金经理,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经理,2020年12月16日至今担任东吴配置   |  |  | 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(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日至今担任东吴和夏江市公共企业,2020年12月16日至今担任东吴和夏江市公共企业,2020年12月16日至今担任东吴和夏江市公共企业,2020年12月16日至今担任东吴和夏江市公共企业,2020年12月16日至今担任东吴和夏江市公共企业,2020年12月16日至今担任东吴和夏江市公共企业,2020年12月16日至今担任东吴和夏江市公共企业,2020年12月16日至今担任东吴和夏江市公共企业,2020年12月16日至今担任东吴和夏江市公共企业,2020年12月16日至今担任东吴和夏江市公共企业,2020年12月16日至今担任东吴和夏江市公共企业,2020年12月16日至今担任东吴和夏江市公共企业,2020年12月16日至今担任东吴和夏江市公共企业,2020年12月16日至今担任东吴和夏江市公共企业,2020年12月16日至今担任东吴和夏江市公共企业,2020年12月16日至全共产党,2020年12月17日,2020年12月 |  |  | 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 日至今担任东吴国金改革主题灵活配置。混合型进产发资基金基金经理,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 日至今担任东吴安藤时及活配金基金经理,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴市政党设备,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴郡市政党公司第12 日本安全,2020 年 12 月 16 日至今担任东吴配置代化灵活配置。   |  |  | 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(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元新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日至今担任东吴安鑫量代灵活配置混合型证券投资基金基理,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经理,2020年12月16日至今担任东吴和策投资基金经理,2020年12月16日至今担任东吴和策投资基金经理,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经  |  |  | 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(是年 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组,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 日至今担任东吴和证券投资基金经理,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9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日至今担任东吴民党强活配置混合型证券投资基金基金经理,2020年12月16日至今担任东吴民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(原东吴深证 100 指数增强型证券投资基金经理, 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  |  |  | 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 日至今担任东吴安豫时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   |  |  | 月 5 日至 2018 年 12 |
| 沪深 300 指数型证券<br>投资基金(原东吴深<br>证 100 指数增强型证<br>券投资基金(LOF))<br>基金经理, 2016 年 2<br>月 5 日至 2017 年 4 月<br>19 日及 2019 年 5 月<br>30 日至今担任东吴国<br>企改革主题灵活配置<br>混合型证券投资基金<br>基金经理, 2016 年 6<br>月 3 日至 2018 年 12<br>月 13 日及 2020 年 7<br>月 23 日至今担任东吴<br>安鑫量化灵活配置混<br>合型证券投资基金基<br>金经理, 2020 年 12 月<br>16 日至今担任东吴多<br>策略灵活配置混合型<br>证券投资基金基金经<br>理, 2020 年 12 月 16<br>日至今担任东吴配置<br>优化灵活配置混合型<br>证券投资基金基金经<br>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 日至今担任东吴国金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  |  |  | 沪深 300 指数型证券     |
| 券投资基金(LOF))<br>基金经理,2016 年 2<br>月 5 日至 2017 年 4 月<br>19 日及 2019 年 5 月<br>30 日至今担任东吴国<br>企改革主题灵活配置<br>混合型证券投资基金<br>基金经理,2016 年 6<br>月 3 日至 2018 年 12<br>月 13 日及 2020 年 7<br>月 23 日至今担任东吴<br>安鑫量化灵活配置混<br>合型证券投资基金基<br>金经理,2020 年 12 月<br>16 日至今担任东吴多<br>策略灵活配置混合型<br>证券投资基金基金经<br>理,2020 年 12 月 16<br>日至今担任东吴配置<br>优化灵活配置混合型<br>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日至今担任东吴和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  |  |  | 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 日至今担任东吴和低不吴和武帝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证券投资基金基金经  |  |  | 券投资基金(LOF))      |
| 19 日及 2019 年 5 月<br>30 日至今担任东吴国<br>企改革主题灵活配置<br>混合型证券投资基金<br>基金经理,2016 年 6<br>月 3 日至 2018 年 12<br>月 13 日及 2020 年 7<br>月 23 日至今担任东吴<br>安鑫量化灵活配置混<br>合型证券投资基金基<br>金经理,2020 年 12 月<br>16 日至今担任东吴多<br>策略灵活配置混合型<br>证券投资基金基金经<br>理,2020 年 12 月 16<br>日至今担任东吴配置<br>优化灵活配置混合型<br>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<br>企改革主题灵活配置<br>混合型证券投资基金<br>基金经理,2016 年 6<br>月 3 日至 2018 年 12<br>月 13 日及 2020 年 7<br>月 23 日至今担任东吴<br>安鑫量化灵活配置混<br>合型证券投资基金基<br>金经理,2020 年 12 月<br>16 日至今担任东吴多<br>策略灵活配置混合型<br>证券投资基金基金经<br>理,2020 年 12 月 16<br>日至今担任东吴配置<br>优化灵活配置混合型<br>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<br>混合型证券投资基金<br>基金经理,2016年6<br>月3日至2018年12<br>月13日及2020年7<br>月23日至今担任东吴<br>安鑫量化灵活配置混<br>合型证券投资基金基<br>金经理,2020年12月<br>16日至今担任东吴多<br>策略灵活配置混合型<br>证券投资基金基金经<br>理,2020年12月16<br>日至今担任东吴配置<br>优化灵活配置混合型<br>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<br>月 23 日至今担任东吴<br>安鑫量化灵活配置混<br>合型证券投资基金基<br>金经理,2020 年 12 月<br>16 日至今担任东吴多<br>策略灵活配置混合型<br>证券投资基金基金经<br>理,2020 年 12 月 16<br>日至今担任东吴配置<br>优化灵活配置混合型<br>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<br>16日至今担任东吴多<br>策略灵活配置混合型<br>证券投资基金基金经<br>理,2020年12月16<br>日至今担任东吴配置<br>优化灵活配置混合型<br>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<br>策略灵活配置混合型<br>证券投资基金基金经<br>理,2020 年 12 月 16<br>日至今担任东吴配置<br>优化灵活配置混合型<br>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<br>证券投资基金基金经<br>理,2020年12月16<br>日至今担任东吴配置<br>优化灵活配置混合型<br>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<br>优化灵活配置混合型<br>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<br>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

基于全球经济复苏的预期,我们认为全球制造业景气将有望回归到正常水平。由于小企业受疫情影响更大,叠加环保和审批趋严的大背景,好的资源未来可能将倾斜于行业龙头,并且龙头公司有着良好的管理能力和现金流可以支持持续扩张,实现市占率和竞争力同步提升的正循环。随着经济复苏,我们认为制造业和周期龙头相对于市场将存在补涨空间。

报告期内,基金以基本面研究为投资的核心依据,首选长期具备成长价值的阿尔法类型标的, 精选未来几年快速成长赛道里优秀的成长标的。

#### 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 1.6791 元;本报告期基金份额净值增长率为 11.78%,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           | 14, 354, 250. 16 | 86. 96       |
|    | 其中: 股票         | 14, 354, 250. 16 | 86. 96       |
| 2  | 基金投资           | _                |              |
| 3  | 固定收益投资         | 699, 090. 00     | 4. 24        |
|    | 其中:债券          | 699, 090. 00     | 4. 24        |
|    | 资产支持证券         | _                | _            |
| 4  | 贵金属投资          | _                | 1            |
| 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   | 1, 441, 234. 20  | 8.73         |
| 8  | 其他资产           | 12, 440. 37      | 0.08         |
| 9  | 合计             | 16, 507, 014. 73 | 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               |                  | _             |
| С  | 制造业               | 13, 898, 480. 16 | 88. 59        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应 业 | -                | -             |
| Е  | 建筑业               |                  | _             |
| F  | 批发和零售业            | 455, 770. 00     | 2. 91         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业       |                  | _             |
| Н  | 住宿和餐饮业            |                  | _             |
| Ι  | 信息传输、软件和信息技术服务业   | 1                | _             |
| 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            | 14, 354, 250. 16 | 91.50 |

### 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<br>比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|------------------|
| 1  | 002493 | 荣盛石化 | 34, 500 | 952, 545. 00 | 6. 07            |
| 2  | 600309 | 万华化学 | 10, 255 | 933, 615. 20 | 5. 95            |
| 3  | 600426 | 华鲁恒升 | 24, 500 | 913, 850. 00 | 5. 83            |
| 4  | 603906 | 龙蟠科技 | 25, 200 | 847, 980. 00 | 5. 41            |
| 5  | 600486 | 扬农化工 | 6, 100  | 805, 200. 00 | 5. 13            |
| 6  | 600176 | 中国巨石 | 39, 100 | 780, 436. 00 | 4. 97            |
| 7  | 002064 | 华峰氨纶 | 73, 500 | 741, 615. 00 | 4. 73            |
| 8  | 002643 | 万润股份 | 33, 600 | 731, 472. 00 | 4. 66            |
| 9  | 600989 | 宝丰能源 | 59, 500 | 696, 150. 00 | 4. 44            |
| 10 | 002597 | 金禾实业 | 21, 300 | 690, 759. 00 | 4. 40            |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种       | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券       | 699, 090. 00 | 4. 46        |
| 2  | 央行票据       | _            | _            |
| 3  | 金融债券       |              |              |
|    | 其中: 政策性金融债 | _            | _            |
| 4  | 企业债券       |              |              |
| 5  | 企业短期融资券    |              |              |
| 6  | 中期票据       | I            | 1            |
| 7  | 可转债(可交换债)  | _            | _            |
| 8  | 同业存单       | _            | _            |
| 9  | 其他         | -            | -            |
| 10 | 合计         | 699, 090. 00 | 4. 46        |

### 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

| 序号 | · 债券代码 | 债券名称     | 数量(张) | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比<br>例(%) |
|----|--------|----------|-------|--------------|------------------|
| 1  | 019640 | 20 国债 10 | 7,000 | 699, 090. 00 | 4. 46            |

# 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

本基金本报告期未投资股指期货。

- 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

本基金本报告期未投资国债期货。

### 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

本基金本报告期未投资国债期货。

### 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   | 3, 958. 75  |
| 2  | 应收证券清算款 | -           |
| 3  | 应收股利    | -           |
| 4  | 应收利息    | 7, 712. 69  |
| 5  | 应收申购款   | 768. 93     |
| 6  | 其他应收款   | -           |
| 7  | 待摊费用    | -           |
| 8  | 其他      | _           |
| 9  | 合计      | 12, 440. 37 |

### 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            | 8, 426, 070. 63 |
|------------------------|-----------------|
| 报告期期间基金总申购份额           | 1, 766, 731. 51 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额         | 849, 912. 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            | 9, 342, 889. 90 |

- 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份额;
  - 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份额。

## § 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 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保本混合型证券投资基金设立的文件(2015年8月19日起东吴保本混合型证券投资基金转型为"东吴配置优化混合型证券投资基金");
- 2、中国证监会批准东吴配置优化混合型证券投资基金设立的文件(2017年12月25日起东吴配置优化混合型证券投资基金转型为"东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金");
  - 3、《东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
  - 4、《东吴配置优化灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
  - 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;
  - 6、报告期内东吴配置优化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 。

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22日