

东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2024年12月5日

送出日期：2024年12月6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 | 东吴安盈量化混合 | 基金代码 | 002270 |
| 下属基金简称 | 东吴安盈量化混合A | | 东吴安盈量化混合C |
| 下属基金代码 | 002270 | | 015154 |
| 下属前端交易代码 | - | | - |
| 下属后端交易代码 | - | | - |
| 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 |
| 基金合同生效日 | 2016-02-03 | 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 | 普通开放式 | 开放频率 | 每个开放日 |
| 基金经理 | 谭菁 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2024-06-21 |
| | | 证券从业日期 | 2015-07-21 |

注：东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金自2022年2月21日起增设C类基金份额。

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 | 本基金通过灵活应用选股、择时量化策略，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。

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%；债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具的投资比例不低于基金资产的5%；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。

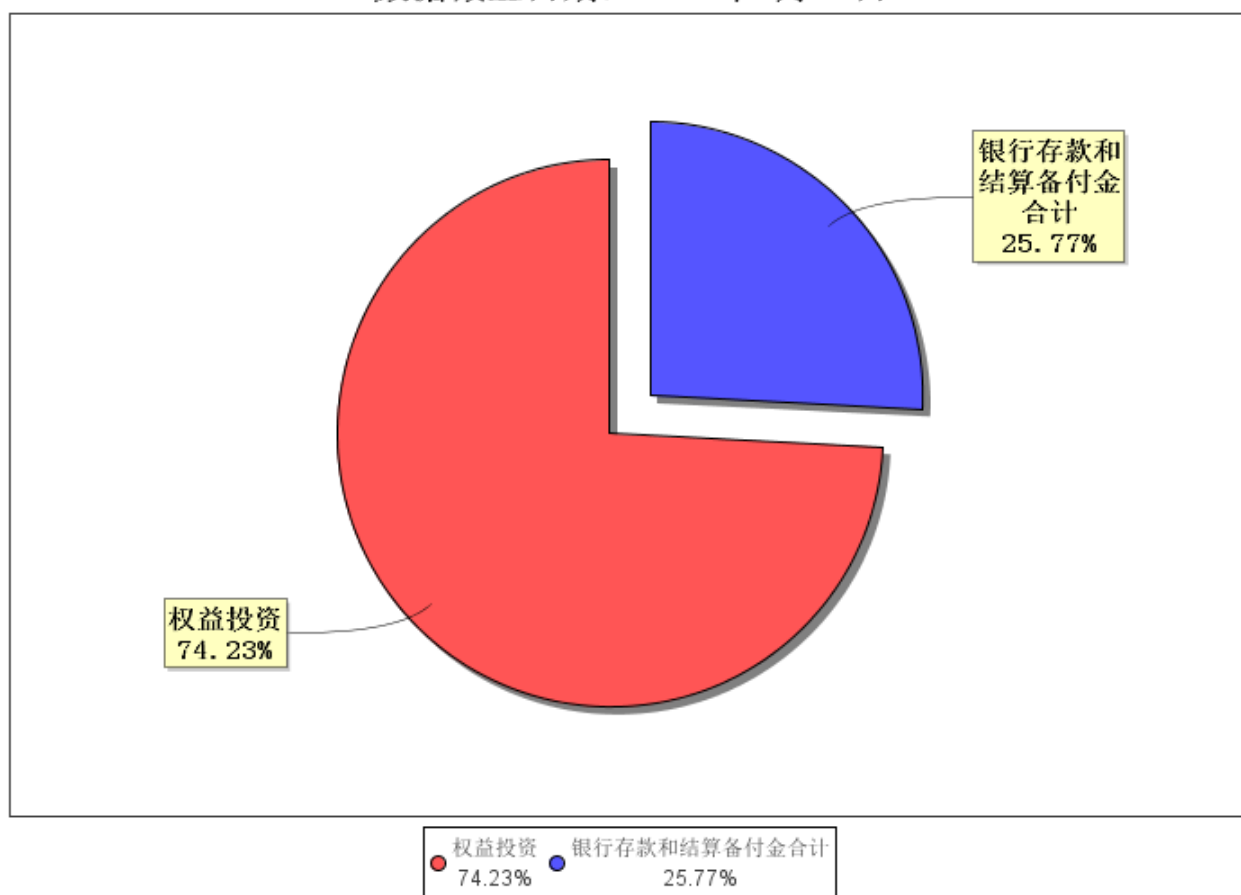
主要投资策略 本基金在资产配置过程中严格遵循自上而下的配置原则，强调投资纪律、避免因随意性投资带来的风险或损失。通过公司数量化模型，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，确定资产配置比例，并进行动态优化管理。

业绩比较基准 基金业绩比较基准=65%*中证500指数收益率+35%*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。

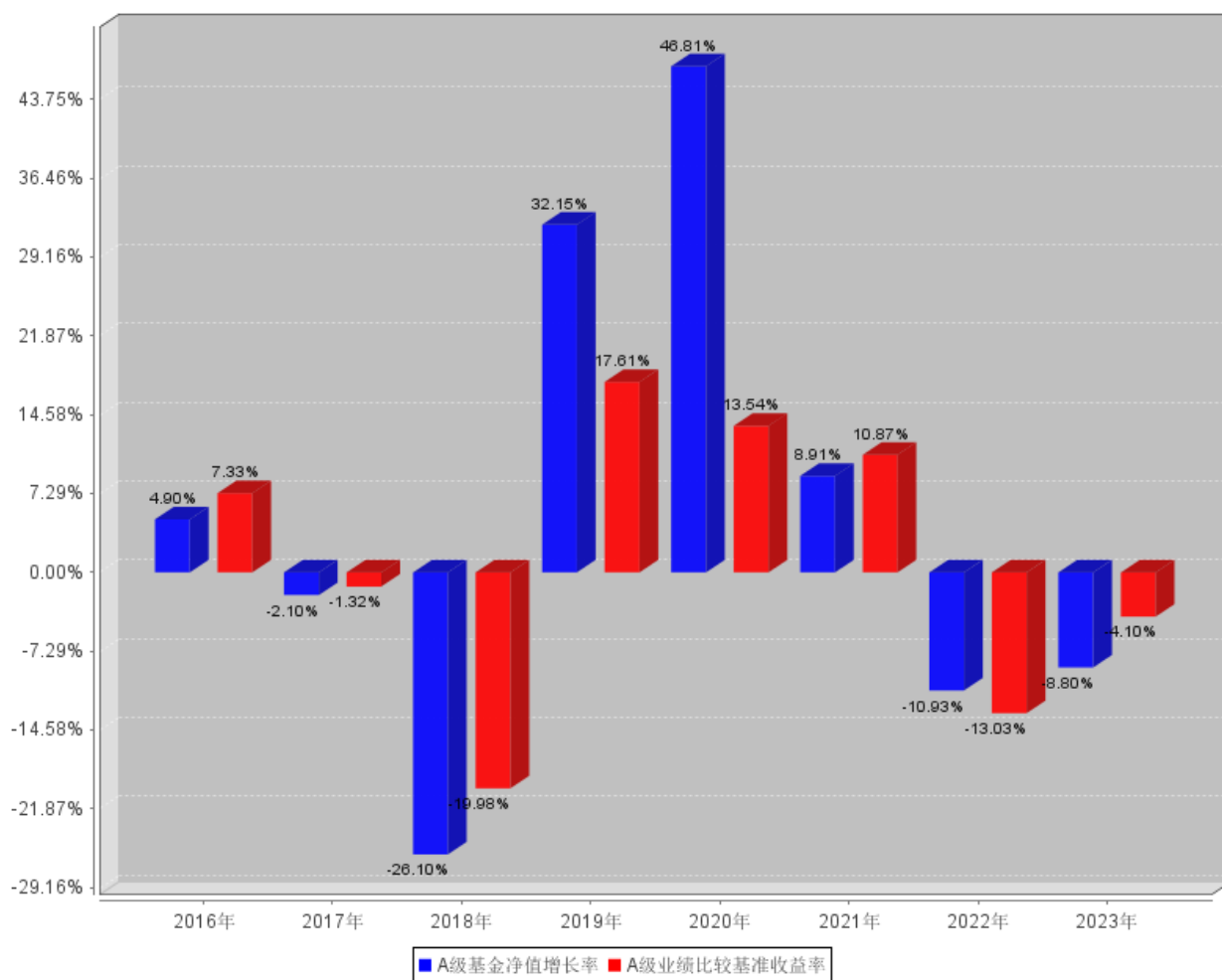
（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

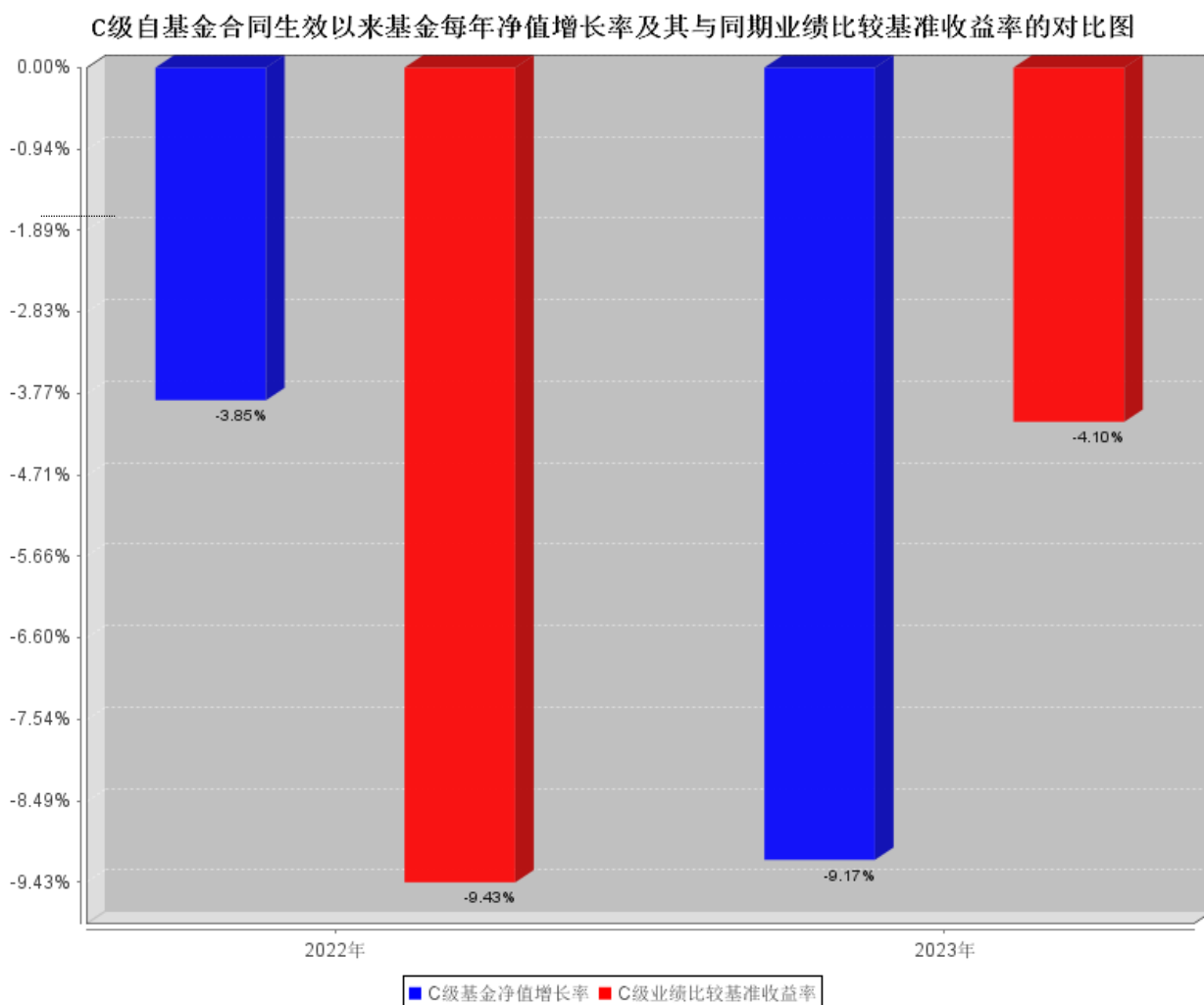
投资组合资产配置图表
数据截止日期：2024年9月30日



（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

A级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





业绩表现截止日期2023年12月31日。基金过往业绩不代表未来表现。

本基金C类份额在2022年2月22日前无有效份额，故该份额的净值增长率与同期业绩比较基准收益率均于2022年2月22日起计算。

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：

东吴安盈量化混合 A

| 费用类型 | 份额(S)或金额(M)/持有期限(N) | 收费方式/费率 | 备注 |
|----------|------------------------|-----------|----|
| 申购费（前收费） | M<1,000,000 | 1.5% - | |
| | 1,000,000≤M<2,000,000 | 1.2% - | |
| | 2,000,000≤M<5,000,000 | 0.8% - | |
| | 5,000,000≤M<10,000,000 | 0.3% - | |
| | M≥10,000,000 | 1000元/笔 - | |
| 赎回费 | N<7天 | 1.50% - | |
| | 7天≤N<30天 | 0.75% - | |
| | 30天≤N<365天 | 0.50% - | |
| | 1年≤N<2年 | 0.25% - | |

| | | |
|------|----|---|
| N≥2年 | 0% | - |
|------|----|---|

东吴安盈量化混合 C

| 费用类型 | 份额（S）或金额（M）/持有期限（N） | 收费方式/费率 | 备注 |
|------|---------------------|---------|----|
| 赎回费 | N<7天 | 1.50% | - |
| | 7天≤N<30天 | 0.50% | - |
| | N≥30天 | 0% | - |

注：1年指365天

（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/年费率或金额 | 收取方 |
|-------|----------------------------------|------------|
| 管理费 | 年费率1.2% | 基金管理人和销售机构 |
| 托管费 | 年费率0.2% | 基金托管人 |
| 销售服务费 | 东吴安盈量化混合A - 东吴安盈量化混合C 年费率0.4% | 销售机构 |
| 审计费用 | 年费用金额47,000.00元 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 年费用金额120,000.00元 | 规定披露报刊 |
| 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：（1）本基金交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

（2）审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

| 东吴安盈量化混合 A | |
|--------------|-------|
| 基金运作综合费率（年化） | 1.45% |
| 东吴安盈量化混合 C | |
| 基金运作综合费率（年化） | 1.85% |

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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。

1、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险。

2、管理风险

基金运作过程中由于基金投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或公司内部失控而可能产生的损失。

3、职业道德风险：是指公司员工不遵守职业操守，发生违法、违规行为而可能导致的损失。

4、流动性风险

本基金属于开放式基金，基金份额可以在基金合同约定的时间和场所进行申购和赎回，因此会面临一定的流动性风险。所谓流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。在基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形，从而导致基金仓位调整的困难，引发流动性风险，甚至影响基金份额净值。

5、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

6、投资管理风险：（1）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；（2）选股方法、选股模型风险；（3）基金经理主观判断错误的风险；（4）其他风险。

7、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。

8、投资资产支持证券的风险

资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险，基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，请基金份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的基金净值波动在内的各项风险。

9、投资科创板股票存在的风险

（1）市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。

科创板个股上市前五日无涨跌幅限制，第六日开始涨跌幅限制在正负20%以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

（2）流动性风险

科创板整体投资门槛较高，个人投资者必须满足交易满两年并且资金在50万以上才可参与，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构持有个股大量流通盘导致个股流动性较差，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

（3）信用风险

科创板试点注册制，对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市制度，科创板个股存在

退市风险。

（4）集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

（5）系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

（6）政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

（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。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

本基金的争议解决处理方式为仲裁。具体仲裁机构和仲裁地点详见本基金合同的具体约定。

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][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

六、其他情况说明