

东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通在江苏银行股份有限公司的定期定额业务及转换业务的公告

为更好的满足广大投资者的理财需求,根据东吴基金管理有限公司(以下简称“东吴基金”)与江苏银行股份有限公司(以下简称“江苏银行”)签署的开放式基金代销协议,自2020年9月14日起,新增开通在江苏银行的基金定期定额投资及转换业务。

一、开通东吴基金旗下部分基金定期定额投资业务
为满足广大投资者的理财需求,东吴基金决定自2020年9月14日起开通以下基金在江苏银行的定期定额投资业务,具体包括:

序号	基金名称	基金代码
1	东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金	002159
2	东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金	002270
3	东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金	002919
4	东吴智慧资管市场基准基金A类/0类	003888/003889
5	东吴安益债券型证券投资基金A类/C类	006134/006136
6	东吴安益三年定期开放债券型证券投资基金A类/C类	006209/006210
7	东吴安腾纯债债券型证券投资基金A类/C类	006273/006274
8	东吴安泰纯债债券型证券投资基金	000626

定期定额投资业务是基金申购业务的一种方式,投资者可以通过江苏银行提交申请,约定每期扣款时间,扣款金额及扣款方式,由江苏银行于约定扣款日在投资者指定资金账户内自动完成扣款及基金申购业务。投资者在办理基金“定期定额投资业务”的同时,仍然可以进行日常申购、赎回业务。

(一)适用投资者
定期定额投资业务适用于依据国家有关法律法规和基金合同约定的可以投资证券投资基金的合格投资者。

(二)办理场所
投资者可通过江苏银行交易系统,办理“定期定额投资业务”申请。

(三)办理方式
1.凡申购东吴基金“定期定额投资业务”的投资者在江苏银行直接开户便可进行东吴基金定期定额投资业务。
2.已开立东吴基金管理有限公司开放式基金账户的投资者,可在江苏银行的交易系统通过账户登录后,办理“定期定额投资业务”申请。

(四)办理时间
本业务的申请受理时间与基金日常申购业务受理时间相同。

(五)扣款金额
投资者应与江苏银行约定每期固定扣款(申购)金额,基金每期定投申购金额最低下限为人民币100元,不设金额级差,具体以代销机构规定为准。

二、开通东吴基金旗下部分基金的基金转换业务
东吴基金将同时在江苏银行开通以下基金之间的转换业务,具体包括:

序号	基金名称	基金代码
1	东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金	002159
2	东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金	002270
3	东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金	002919
4	东吴智慧资管市场基准基金A类/0类	003888/003889
5	东吴安益债券型证券投资基金A类/C类	006134/006136
6	东吴安益三年定期开放债券型证券投资基金A类/C类	006209/006210
7	东吴安腾纯债债券型证券投资基金A类/C类	006273/006274
8	东吴安泰纯债债券型证券投资基金	000626

(一)基金转换业务适用投资者范围
已持有本公司管理的开放式基金产品的投资者。

(二)基金转换受理时间
基金办理转换业务的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所交易日(本公司公告暂停转换除外)。具体业务办理时间与基金日常申购业务时间相同。

(三)基金转换业务规则
1.基金转换是指开放式基金份额持有人将其持有的某只基金的部分或全部份额转换为同一基金管理人管理的另一只开放式基金的份额。

2.基金转换只能转换为本公司管理的,同一注册登记人登记托管的,同一基金账户下的基金份额,且只能在同一销售机构进行,且该销售机构须同时代理拟转出基金及拟转入基金的销售;

3.拟转出的基金必须处于可赎回状态,拟转入的基金必须处于可申购状态;

4.目前只开通前端收费模式下进行基金转换,而不能将前端收费基金份额转换为后端收费基金份额,或其后端收费基金份额转换为前端收费基金份额。如今后本公司开通后端收费模式基金的转换业务,具体转换业务规则则以相关公告内容为准;

5.基金转换遵循“份额赎回”的原则,转换申请份额精确到小数点后两位,单笔转换申请份额不得低于100份。单笔转入申请不受转入基金最低申购限额限制和转出基金最低赎回限额限制。

6.对于基金分红时,权益登记日申请转换转入的基金份额享有该次分红权益,权益登记日申请转换转入的基金份额不享有该次分红权益;

7.基金转换采取未知价法,即基金的转换价格以转换申请受理当日各转出、转入基金份额净值为基础进行计算;

8.转换业务遵循“先进先出”的业务规则,先确认的认购或者申购的基金份额在转换时先赎回;

9.单个开放日基金赎回份额及净转出转出申请份额之和超出上一开放日基金总份额的10%时,为巨额赎回。发生巨额赎回时,基金转出与基金赎回具有相同的优先权,基金管理人可根据基金资产组合情况,决定全额转出或部分转出,并且对于基金转出和基金赎回,将采取相同的比例确认。在转出申请得到部分确认的情况下,未确认的转出申请将不予以顺延;

10.转入基金的持有时间将重新计算,与转出基金的持有时间无关;

11.投资者在T日办理的基金转换申请,基金注册登记人在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认,在T+2日后(包括该日)投资者可通过江苏银行发售机构和江苏银行官网查询交易情况;

12.基金转换费用由基金持有人承担;

13.本公司将根据今后发行的其他开放式基金的具体情况对本业务规则进行补充和调整。

(四)基金转换费及份额计算方法
基金转换费用由转出基金的赎回费与转入基金的申购费补差两部分构成,具体收取标准视每次转换时两只基金的申购费率差异情况和赎回费率而定。基金转换费用由基金持有人承担。

转换公式如下:
1)转出金额=转出基金份额×转出基金T日基金份额净值
(此处的T日指基金转换申请日,下同)
2)转入金额=转出金额×转出基金赎回费率+转出基金赎回费
(注:转出赎回费的至少25%将归入转出方基金的基金财产,具体计入比例详见基金合同)

3)转入金额=转出金额-转出赎回费
4)如果,转出基金的申购费率<转入基金的申购费率,申购补差费率=转入基金的申购费率-转出基金的申购费率
申购补差费率=转入金额×(申购补差费率)/(1+申购补差费率)
转入净额=转入金额-申购补差费率
如果,转出基金的申购费率≥转入基金的申购费率,转入净额=转入金额

5)转入金额=转入净额-转入基金T日基金份额净值
其中,转入基金的申购费率和转出基金的申购费率均以转出金额为确定依据。
6)转出金额、转出基金份额的计算保留小数点后两位,第三位四舍五入,由此产生的误差在转出基金资产中列支;转入金额、申购补差费率的计算保留小数点后两位,第三位四舍五入,由此产生的误差在转入基金资产中列支。

9.对于实行前端申购费率的(不同申购金额对应不同申购费率)的基金,以转入总金额对应的转出基金申购费率、转入基金申购费率计算申购补差费用;如转入总金额对应转出基金申购费或转入基金申购费为固定费用时,申购补差费用视为0。

4.计算基金转换费用所涉及的申购费率和赎回费率均按基金合同、更新的招募说明书规定费率执行,对于通过本公司网上交易,费率优惠活动期间发生的基金转换业务,按照本公司最新公告的相关费率计算基金转换费用。

(五)暂停基金转换的情形及处理
出现下列情况之一时,基金管理人可以暂停接受基金份额持有人的基金转换申请:
1.不可抗力导致基金无法正常工作;
2.证券交易市场或交易市场非正常停市或证券交易所依法临时停市,导致当日基金资产净值无法计算;

3.因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回,导致基金的现金支付出现困难;
4.基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔转入或某笔转出;
5.发生基金合同约定的暂停基金资产估值情况;
6.基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人的利益;

7.法律、法规、规章规定的其他情形或其他在《基金合同》、《招募说明书》已载明并获中国证监会批准的特殊情形。
基金转换或暂停后重新开放转换时,基金管理人应立即向中国证监会备案并在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

三、重要提示
投资者可通过以下途径咨询有关详情:
1)江苏银行股份有限公司
客户服务热线:96319
公司网址:www.jsbchina.cn

2)东吴基金管理有限公司
客户服务热线:400-821-0688(免长途话费)
公司网址:www.scfund.com.cn

四、风险提示
本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。敬请投资者在投资前认真阅读我司旗下基金的《基金合同》和《招募说明书》。

特此公告。
东吴基金管理有限公司
2020年9月11日

东吴基金管理有限公司关于参加江苏银行股份有限公司费率优惠的公告

为答谢广大客户长期以来给予的信任与支持,经与江苏银行股份有限公司(以下简称“江苏银行”)协商一致,东吴基金管理有限公司(以下简称“本公司”)决定旗下基金参加江苏银行费率优惠。现将具体费率优惠情况公告如下:

一、费率优惠内容
自2020年9月14日起,投资者通过江苏银行(认)申购(含定期定额申购)本公司旗下基金,(认)申购费率我司后台不设折扣限制,以江苏银行上报费率为准。具体参与费率优惠的基金产品及折扣费率请参见江苏银行相关公告。基金原费率详见基金合同、招募说明书(更新)等法律文件,以及本公司发布的最新业务公告。

费率优惠期限内,如本公司新增通过江苏银行代销的基金产品,则自该基金产品开放申购当日,将同时开通该基金上述费率优惠。

二、费率优惠期限
以江苏银行官方网站所示公告为准。

三、重要提示
1.本费率优惠仅适用于我司产品在江苏银行处于正常申购期的基金产品的前端收费模式的申购手续费(含定期定额申购)及处于基金募集期的基金认购费。
2.本费率优惠仅适用于我司产品在江苏银行认(申)购业务的手续费,不包括基金赎回等其他业务的手续费。

3.费率优惠解释权归江苏银行所有,有关费率优惠的具体规定如有变化,敬请投资者留意相关代销机构的有关规定。

4.费率优惠期间,业务办理流程以江苏银行的规定为准。投资者欲了解基金产品的详细情况,请仔细阅读基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

三、投资者可通过以下途径了解或咨询有关情况:
1)江苏银行股份有限公司
客户服务热线:96319
公司网址:www.jsbchina.cn

2)东吴基金管理有限公司
客户服务热线:400-821-0688(免长途话费)
公司网址:www.scfund.com.cn

风险提示:本公司承诺以诚实信用、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,也不保证最低收益。敬请投资者注意投资风险。投资者投资于上述基金前应认真阅读基金的基金合同、更新的招募说明书。

特此公告。
东吴基金管理有限公司
2020年9月11日

东吴安享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)

本概要提供本基金的重要信息,是招募说明书的一部分。作出投资决策前,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	东吴安享量化混合	基金代码	680007
基金管理人	东吴基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2017-02-22	上市交易及上市日期	暂未上市
基金类型	混合型	交易所	人民币
基金类别	开放式	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	刘闯	开始担任本基金基金经理的日期	2019-11-20
		证券从业日期	2013-03-04
其他	东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金由东吴新业成长混合型证券投资基金转型而来。		

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》第八章了解详细情况

投资目标 本基金在充分控制风险的前提下,采用定量、定性相结合的策略进行资产配置,追求持续的资产增值。

投资范围 本基金投资于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(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、权证、股指期货、国债、金融债、企业债、公募债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具以及法律法规中国证监会允许基金投资的其它金融工具,且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,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的70%-95%,投资于债券等固定收益类资产不高于基金资产的30%,每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年以内的政府债券的比例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。

(一)策略说明
1.资产配置策略
(1)行业配置
(2)个股配置

本基金采用多因子模型进行个股优选,主要参考估值因子、成长因子、盈利因子、分红因子、反财务指标、前五大因子为长期有效因子,在短期会考虑动量因子,其余因子的权重根据市场环境进行动态调整。具体选股策略包括不限于动量因子、P/B、P/E等,体现选股策略不限于但不限于净利率的长期增长、净利润短期增长、主营业务收入增长等,体现盈利平面的因子包括但不限于分红、毛利率等。

3.资产配置投资策略,4.股指期货投资策略,5.权证投资策略,6.固定收益类资产配置策略

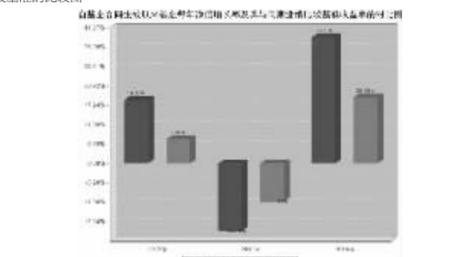
业绩比较基准 沪深300指数收益率×55%+中国国债综合价格指数收益率×45%

风险收益特征 本基金是一只善于主动管理的混合型基金,其预期风险和预期收益均高于货币型基金和债券型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种,预期风险和预期收益均高于货币型基金和债券型基金,本基金通过资产配置,精选个股等投资策略的实施和积极的风险管理而追求较高收益。

(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)持有年限(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%	
赎回费	M < 100万	1.50%/0.00%	
	100万 ≤ M < 1000万	0.30%	
	M ≥ 1000万	0.00%/0.00%	
赎回费	N < 7天	1.50%	
	7天 ≤ N < 30天	0.75%	
	30天 ≤ N < 1年	0.40%	
	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收,按实际发生额从基金资产扣除。

(一)风险提示
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、流动性风险、策略风险及其他风险等。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不到位、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。

(三)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本基金合同的当事人。

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,如届时,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:400-821-0688

- 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

东吴安鑫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)

本概要提供本基金的重要信息,是招募说明书的一部分。作出投资决策前,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	东吴安鑫量化混合	基金代码	002161
基金管理人	东吴基金管理有限公司	基金托管人	江苏银行股份有限公司
基金合同生效日	2016-06-03	上市交易及上市日期	暂未上市
基金类型	混合型	交易所	人民币
基金类别	开放式	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	陶闯	开始担任本基金基金经理的日期	2020-07-23
		证券从业日期	2009-08-01
其他	东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金由东吴新业成长混合型证券投资基金转型而来。		

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 本基金采用量化选股与择时策略进行资产配置,追求持续的资产增值。

投资范围 本基金投资于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(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、权证、股指期货、国债、金融债、企业债、公募债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具以及法律法规中国证监会允许基金投资的其它金融工具,且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,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的70%-95%,投资于债券等固定收益类资产不高于基金资产的30%,每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年以内的政府债券的比例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。

(一)策略说明
1.资产配置策略
(1)行业配置
(2)个股配置

本基金采用多因子模型进行个股优选,主要参考估值因子、成长因子、盈利因子、分红因子、反财务指标、前五大因子为长期有效因子,在短期会考虑动量因子,其余因子的权重根据市场环境进行动态调整。具体选股策略包括不限于动量因子、P/B、P/E等,体现选股策略不限于但不限于净利率的长期增长、净利润短期增长、主营业务收入增长等,体现盈利平面的因子包括但不限于分红、毛利率等。

3.资产配置投资策略,4.股指期货投资策略,5.权证投资策略,6.固定收益类资产配置策略

业绩比较基准 68%×沪深300指数收益率+32%×中国国债综合价格指数收益率

风险收益特征 本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种,预期风险和预期收益均高于货币型基金和债券型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种,预期风险和预期收益均高于货币型基金和债券型基金,本基金通过资产配置,精选个股等投资策略的实施和积极的风险管理而追求较高收益。

(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

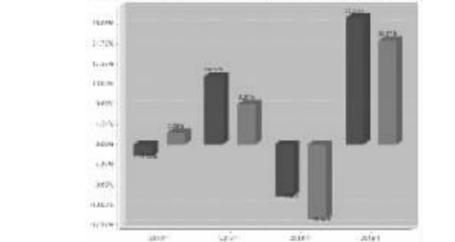


(三)自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的对比图

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)持有年限(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%	
赎回费	M < 100万	1.50%/0.00%	
	100万 ≤ M < 1000万	0.30%	
	M ≥ 1000万	0.00%/0.00%	
赎回费	N < 7天	1.50%	
	7天 ≤ N < 30天	0.75%	
	30天 ≤ N < 1年	0.40%	
	1年 ≤ N < 2年	0.25%	
	N ≥ 2年	0.00%	

(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收,按实际发生额从基金资产扣除。

四、风险提示
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、流动性风险、策略风险及其他风险等。本基金特有风险如下:

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,产生风险。

2.管理风险
在基金管理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.股指期货期货的风险
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