

永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金

[2016]第四季度报告

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:华泰证券股份有限公司

报告送出日期:2017年1月20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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年1月18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2016年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

序号	项目	金额(亿元)	占基金资产的比例(%)
1	货币市场	66,212,067.701	100.00
2	股票	0.00	0.00
3	固定收益	0.00	0.00
4	权证	0.00	0.00
5	基金	0.00	0.00
6	金融衍生品	0.00	0.00
7	其他	0.00	0.00
8	合计	66,212,067.701	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

序号	行业类别	金额(亿元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	261,434.00	0.42
B	采矿业	30,000,790.40	50.44
C	制造业	2,799,034.00	4.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
E	批发和零售业	6,060,073.20	11.08
F	交通运输、仓储和邮政业	2,000,268.00	3.65
G	住宿和餐饮业	0.00	0.00
H	信息、计算机、通信和其他电子设备制造业	855,050.00	1.57
I	计算机、通信和其他电子设备制造业	855,050.00	1.57
J	纺织业	0.00	0.00
K	化学、石化及塑料业	4,054,160.00	7.26
L	医药制造业	0.00	0.00
M	技术服务业	0.00	0.00
N	房地产业	0.00	0.00
O	批发和零售业	0.00	0.00
P	住宿和餐饮业	0.00	0.00
Q	教育	0.00	0.00
R	卫生、社会保障和社会福利业	0.00	0.00
S	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
T	其他服务业	0.00	0.00
U	租赁和商务服务业	0.00	0.00
V	交通运输、仓储和邮政业	220,100.00	0.37
W	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
X	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
Y	批发和零售业	0.00	0.00
Z	住宿和餐饮业	0.00	0.00
合计		66,212,067.701	100.00

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	000021	海信电器	68,400	698,394.00	1.01
2	000660	江铃汽车	26,000	691,200.00	1.01
3	000635	上海电气	36,400	691,000.00	1.01
4	000600	海信科龙	23,200	683,000.00	1.04
5	000602	万科A	18,300	681,300.00	1.04
6	000604	广日股份	49,500	676,665.00	1.03
7	000606	鲁泰A	68,200	647,210.00	1.00
8	000602	中远海能	94,700	644,907.00	1.07
9	000635	国机汽车	52,900	642,726.00	1.07
10	000601	深物业A	91,700	634,664.00	1.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.4.1 本基金本期未持有债券。

5.4.2 本基金本期未持有资产占净值比例较大的债券。

5.4.3 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.4 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.5 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.6 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.7 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.8 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.9 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.10 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.11 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.12 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.13 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.14 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.15 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.16 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.17 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.18 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.19 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.20 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.21 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.22 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.23 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.24 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.25 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.26 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.27 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.28 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.29 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.30 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.31 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.32 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.33 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.34 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.35 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.36 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.37 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.38 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.39 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.40 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.41 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.42 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.43 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.44 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.45 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.46 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.47 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.48 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.49 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.50 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.51 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.52 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.53 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.54 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.55 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.56 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.57 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.58 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.59 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.60 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.61 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.62 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.63 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.64 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.65 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.66 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.67 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.68 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.69 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.70 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.71 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.72 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.73 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.74 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.75 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.76 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.77 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.78 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.79 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.80 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.81 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.82 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.83 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.84 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。

5.4.85 本基金本期未持有资产占净值比例最大的债券。