

东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:东兴证券股份有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月21日

1 重要提示

基金管理人东兴证券股份有限公司(以下简称“东兴证券”)根据《证券投资基金信息披露管理办法》,于2017年4月21日编制了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证基金资产不存在虚假记载、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预示其未来表现。投资者有风险,投资需谨慎。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。
本报告期自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

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		223,506.64	0.74
B 采矿业		163,714.00	0.54
C 制造业		19,116,933.69	63.08
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业		347,438.78	1.15
E 建筑业		617,388.24	2.04
F 批发和零售业		1,598,797.11	5.24
G 交通运输、仓储和邮政业		438,211.04	1.45
H 住宿和餐饮业		—	—
I 信息传输、软件和信息技术服务业		1,624,616.79	5.36
J 金融业		111,350.00	0.37
K 房地产业		630,946.29	1.96
L 租赁和商务服务业		293,138.29	0.93
M 科学研究和技术服务业		416,400.00	0.37
N 水利、环境和公共设施管理业		112,297.00	0.46
O 医药服务、修理和其他服务业		—	—
P 教育		56,335.00	0.18
Q 卫生和社会工作		189,028.75	0.66
R 文化、体育和娱乐业		412,892.92	1.36
S 综合		—	—
合计		26,310,422.25	86.82

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	002848	宁波银行	10,708	242,107.88	0.80
2	300496	东兴证券	9,800	221,774.00	0.73
3	300109	新开源	4,500	209,320.00	0.69
4	300320	海达股份	12,000	201,940.00	0.67
5	002640	跨境通	11,300	193,622.00	0.64
6	002626	胜利精密	24,600	188,328.00	0.62
7	300485	赛福药业	4,000	182,252.00	0.60
8	300279	福瑞科技	4,700	181,394.00	0.60
9	002270	华明装备	12,100	177,386.00	0.59
10	603139	九华旅游	4,700	172,206.00	0.57

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	国债券	2,996,400.00	9.89
2	央行票据	—	—
3	金融债	—	—
4	其中:政策性金融债	—	—
5	企业债	—	—
6	企业短期融资券	—	—
7	中期票据	—	—
8	可转债	—	—
9	同业存单	—	—
10	其他	—	—
合计		2,996,400.00	9.89

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)	占基金资产净值比例(%)
1	019546	16国债16	30,000	2,996,400.00	9.89

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2 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
1	存出保证金	67,578.88
2	应收证券清算款	27,495,363.41
3	应收股利	—
4	应收利息	42,638.96
5	应收申购款	9982.00
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	27,576,566.62

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300496	东兴证券	221,774.00	0.73	重大资产重组停牌
2	300109	新开源	209,320.00	0.69	重大资产重组停牌
3	300320	海达股份	201,940.00	0.67	重大资产重组停牌
4	002640	跨境通	193,622.00	0.64	重大资产重组停牌
5	002626	胜利精密	188,328.00	0.62	重大资产重组停牌
6	002270	华明装备	177,386.00	0.59	重大资产重组停牌

5.11.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.11.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11.8 投资组合报告附注

报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚。

5.11.9 其他资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	67,578.88
2	应收证券清算款	27,495,363.41
3	应收股利	—
4	应收利息	42,638.96
5	应收申购款	9982.00
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	27,576,566.62

5.11.10 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。

5.11.11 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300496	东兴证券	221,774.00	0.73	重大资产重组停牌
2	300109	新开源	209,320.00	0.69	重大资产重组停牌
3	300320	海达股份	201,940.00	0.67	重大资产重组停牌
4	002640	跨境通	193,622.00	0.64	重大资产重组停牌
5	002626	胜利精密	188,328.00	0.62	重大资产重组停牌
6	002270	华明装备	177,386.00	0.59	重大资产重组停牌

5.11.12 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.11.13 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11.14 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。

5.11.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300496	东兴证券	221,774.00	0.73	重大资产重组停牌
2	300109	新开源	209,320.00	0.69	重大资产重组停牌
3	300320	海达股份	201,940.00	0.67	重大资产重组停牌
4	002640	跨境通	193,622.00	0.64	重大资产重组停牌
5	002626	胜利精密	188,328.00	0.62	重大资产重组停牌
6	002270	华明装备	177,386.00	0.59	重大资产重组停牌

5.11.16 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.11.17 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11.18 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。

5.11.19 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300496	东兴证券	221,774.00	0.73	重大资产重组停牌
2	300109	新开源	209,320.00	0.69	重大资产重组停牌
3	300320	海达股份	201,940.00	0.67	重大资产重组停牌
4	002640	跨境通	193,622.00	0.64	重大资产重组停牌
5	002626	胜利精密	188,328.00	0.62	重大资产重组停牌
6	002270	华明装备	177,386.00	0.59	重大资产重组停牌

5.11.20 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.11.21 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11.22 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。

5.11.23 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300496	东兴证券	221,774.00	0.73	重大资产重组停牌
2	300109	新开源	209,320.00	0.69	重大资产重组停牌
3	300320	海达股份	201,940.00	0.67	重大资产重组停牌
4	002640	跨境通	193,622.00	0.64	重大资产重组停牌
5	002626	胜利精密	188,328.00	0.62	重大资产重组停牌
6	002270	华明装备	177,386.00	0.59	重大资产重组停牌

5.11.24 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.11.25 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11.26 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。

5.11.27 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300496	东兴证券	221,774.00	0.73	重大资产重组停牌
2	300109	新开源	209,320.00	0.69	重大资产重组停牌
3	300320	海达股份	201,940.00	0.67	重大资产重组停牌
4	002640	跨境通	193,622.00	0.64	重大资产重组停牌
5	002626	胜利精密	188,328.00	0.62	重大资产重组停牌
6	002270	华明装备	177,386.00	0.59	重大资产重组停牌

5.11.28 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.11.29 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11.30 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。

5.11.31 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300496	东兴证券	221,774.00	0.73	重大资产重组停牌
2	300109	新开源	209,320.00	0.69	重大资产重组停牌
3	300320	海达股份	201,940.00	0.67	重大资产重组停牌
4	002640	跨境通	193,622.00	0.64	重大资产重组停牌
5	002626	胜利精密	188,328.00	0.62	重大资产重组停牌
6	002270	华明装备	177,386.00	0.59	重大资产重组停牌

5.11.32 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.11.33 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11.34 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。

5.11.35 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300496	东兴证券	221,774.00	0.73	重大资产重组停牌
2	300109	新开源	209,320.00	0.69	重大资产重组停牌
3	300320	海达股份	201,940.00	0.67	重大资产重组停牌
4	002640	跨境通	193,622.00	0.64	重大资产重组停牌
5	002626	胜利精密	188,328.00	0.62	重大资产重组停牌
6	002270	华明装备	177,386.00	0.59	重大资产重组停牌

5.11.36 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.11.37 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11.38 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。

5.11.39 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300496	东兴证券	221,774.00	0.73	重大资产重组停牌
2	300109	新开源	209,320.00	0.69	重大资产重组停牌
3	300320	海达股份	201,940.00	0.67	重大资产重组停牌
4	002640	跨境通	193,622.00	0.64	重大资产重组停牌
5	002626	胜利精密	188,328.00	0.62	重大资产重组停牌
6	002270	华明装备	177,386.00	0.59	重大资产重组停牌

5.11.40 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.11.41 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11.42 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。

5.11.43 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300496	东兴证券	221,774.00	0.73	重大资产重组停牌
2	300109	新开源	209,320.00	0.69	重大资产重组停牌
3	300320	海达股份	201,940.00	0.67	重大资产重组停牌
4	002640	跨境通	193,622.00	0.64	重大资产重组停牌
5	002626	胜利精密	188,328.00	0.62	重大资产重组停牌
6	002270	华明装备	177,386.00	0.59	重大资产重组停牌

5.11.44 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.11.45 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11.46 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。

5.11.47 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300496	东兴证券	221,774.00	0.73	重大资产重组停牌
2	300109	新开源	209,320.00	0.69	重大资产重组停牌
3	300320	海达股份	201,940.00	0.67	重大资产重组停牌
4	002640	跨境通	193,622.00	0.64	重大资产重组停牌
5	002626	胜利精密	188,328.00	0.62	重大资产重组停牌
6	002270	华明装备	177,386.00	0.59	重大资产重组停牌

5.11.48 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.11.49 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11.50 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。

5.11.51 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300496	东兴证券	221,774.00	0.73	重大资产重组停牌
2	300109	新开源	209,320.00	0.69	重大资产重组停牌
3	300320	海达股份	201,940.00	0.67	重大资产重组停牌
4	002640	跨境通	193,622.00	0.64	重大资产重组停牌
5	002626	胜利精密	188,328.00	0.62	重大资产重组停牌
6	002270	华明装备	177,386.00	0.59	重大资产重组停牌

5.11.52 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.11.53 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11.54 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。

5.11.55 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300496	东兴证券	221,774.00	0.73	重大资产重组停牌
2	300109	新开源	209,320.00	0.69	重大资产重组停牌
3	300320	海达股份	201,940.00	0.67	重大资产重组停牌
4	002640	跨境通	193,622.00	0.64	重大资产重组停牌
5	002626	胜利精密	188,328.00	0.62	重大资产重组停牌
6	002270	华明装备	177,386.00	0.59	重大资产重组停牌

永赢双利债券型证券投资基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:永赢基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月21日