

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:中航证券有限公司

报告送出日期:2017年4月21日

§ 1 重要提示及目录

基金管理人及董事会对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。基金托管人报告了本基金的财务指标、净值表现和投资组合报告,但未对本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等发表意见,投资人应当认真阅读。

基金经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。投资人选择基金,应综合考虑基金的招募说明书。

本报告期自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:东兴量化策略混合

基金主代码:002200

契约型开放式

基金合同生效日:2016年10月12日

报告期末基金份额总额:62,506,264.69份

投资目标:本基金通过量化分析的方法和合理的仓位控制,力争实现超越行业平均水平的净值增长。

投资策略:本基金主要采用量化分析的方法,通过量化分析方法选择多种有效的投资策略,在投资过程中最大限度地降低投资组合的波动率,并通过择时的判断,把握市场的投资机会。

业绩比较基准:中证800指数*60%+沪深300指数*20%+银行存款*20%

风险收益特征:本基金为混合型基金,风险及预期收益水平高于货币市场基金,低于股票型基金。

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

§ 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(2017年1月1日-2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -1,169,537.33

2.本期利润 -806,394.74

3.期末基金资产净值 30,303,372.02

4.期末基金份额净值 0.9886

注:1.基金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.所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指标。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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 准确率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -2.76% 0.93% 2.39% 0.36% -5.15% 0.05%

3.2.2 本基金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:本基金基金合同期于2016年10月27日生效,截至报告期末,本基金合同生效不满六个月,仍处于建仓期。

§ 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

任职日期 离任日期

李伟杰先生 本基金基金经理 2016年10月27日 - 6年 中央财经大学金融学硕士,6年以上证券从业经验,历任东兴证券研究所研究员,2016年10月加入东兴证券股份有限公司,历任东兴证券量化投资部研究员、量化投资部基金经理,现任东兴证券量化投资部基金经理。

4.2 管理人的尽职守信说明

4.3 公平交易制度的执行情况

4.4 报告期内基金管理人公平交易行为分析

4.5 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.6 报告期内基金管理人公平交易行为的专项说明

4.7 管理人对宏观经济的专项说明

4.8 管理人对行业及市场的专项说明

4.9 管理人对本基金投资策略的专项说明

4.10 管理人对基金估值政策的专项说明

4.11 管理人对基金业绩的专项说明

4.12 管理人对基金组合投资的专项说明

4.13 管理人对基金交易的专项说明

4.14 管理人对基金投资策略的专项说明

4.15 管理人对基金投资策略的专项说明

4.16 管理人对基金投资策略的专项说明

4.17 管理人对基金投资策略的专项说明

4.18 管理人对基金投资策略的专项说明

4.19 管理人对基金投资策略的专项说明

4.20 管理人对基金投资策略的专项说明

4.21 管理人对基金投资策略的专项说明

4.22 管理人对基金投资策略的专项说明

4.23 管理人对基金投资策略的专项说明

4.24 管理人对基金投资策略的专项说明

4.25 管理人对基金投资策略的专项说明

4.26 管理人对基金投资策略的专项说明

4.27 管理人对基金投资策略的专项说明

4.28 管理人对基金投资策略的专项说明

4.29 管理人对基金投资策略的专项说明

4.30 管理人对基金投资策略的专项说明

4.31 管理人对基金投资策略的专项说明

4.32 管理人对基金投资策略的专项说明

4.33 管理人对基金投资策略的专项说明

4.34 管理人对基金投资策略的专项说明

4.35 管理人对基金投资策略的专项说明

4.36 管理人对基金投资策略的专项说明

4.37 管理人对基金投资策略的专项说明

4.38 管理人对基金投资策略的专项说明

4.39 管理人对基金投资策略的专项说明

4.40 管理人对基金投资策略的专项说明

4.41 管理人对基金投资策略的专项说明

4.42 管理人对基金投资策略的专项说明

4.43 管理人对基金投资策略的专项说明

4.44 管理人对基金投资策略的专项说明

4.45 管理人对基金投资策略的专项说明

4.46 管理人对基金投资策略的专项说明

4.47 管理人对基金投资策略的专项说明

4.48 管理人对基金投资策略的专项说明

4.49 管理人对基金投资策略的专项说明

4.50 管理人对基金投资策略的专项说明

4.51 管理人对基金投资策略的专项说明

4.52 管理人对基金投资策略的专项说明

4.53 管理人对基金投资策略的专项说明

4.54 管理人对基金投资策略的专项说明

4.55 管理人对基金投资策略的专项说明

4.56 管理人对基金投资策略的专项说明

4.57 管理人对基金投资策略的专项说明

4.58 管理人对基金投资策略的专项说明

4.59 管理人对基金投资策略的专项说明

4.60 管理人对基金投资策略的专项说明

4.61 管理人对基金投资策略的专项说明

4.62 管理人对基金投资策略的专项说明

4.63 管理人对基金投资策略的专项说明

4.64 管理人对基金投资策略的专项说明

4.65 管理人对基金投资策略的专项说明

4.66 管理人对基金投资策略的专项说明

4.67 管理人对基金投资策略的专项说明

4.68 管理人对基金投资策略的专项说明

4.69 管理人对基金投资策略的专项说明

4.70 管理人对基金投资策略的专项说明

4.71 管理人对基金投资策略的专项说明

4.72 管理人对基金投资策略的专项说明

4.73 管理人对基金投资策略的专项说明

4.74 管理人对基金投资策略的专项说明

4.75 管理人对基金投资策略的专项说明

4.76 管理人对基金投资策略的专项说明

4.77 管理人对基金投资策略的专项说明

4.78 管理人对基金投资策略的专项说明

4.79 管理人对基金投资策略的专项说明

4.80 管理人对基金投资策略的专项说明

4.81 管理人对基金投资策略的专项说明

4.82 管理人对基金投资策略的专项说明

4.83 管理人对基金投资策略的专项说明

4.84 管理人对基金投资策略的专项说明

4.85 管理人对基金投资策略的专项说明

4.86 管理人对基金投资策略的专项说明

4.87 管理人对基金投资策略的专项说明

4.88 管理人对基金投资策略的专项说明

4.89 管理人对基金投资策略的专项说明

4.90 管理人对基金投资策略的专项说明

4.91 管理人对基金投资策略的专项说明

4.92 管理人对基金投资策略的专项说明

4.93 管理人对基金投资策略的专项说明

4.94 管理人对基金投资策略的专项说明

4.95 管理人对基金投资策略的专项说明

4.96 管理人对基金投资策略的专项说明

4.97 管理人对基金投资策略的专项说明

4.98 管理人对基金投资策略的专项说明

4.99 管理人对基金投资策略的专项说明

4.10 管理人对基金投资策略的专项说明

4.11 管理人对基金投资策略的专项说明

4.12 管理人对基金投资策略的专项说明

4.13 管理人对基金投资策略的专项说明

4.14 管理人对基金投资策略的专项说明

4.15 管理人对基金投资策略的专项说明

4.16 管理人对基金投资策略的专项说明

4.17 管理人对基金投资策略的专项说明

4.18 管理人对基金投资策略的专项说明

4.19 管理人对基金投资策略的专项说明

4.20 管理人对基金投资策略的专项说明

4.21 管理人对基金投资策略的专项说明

4.22 管理人对基金投资策略的专项说明

4.23 管理人对基金投资策略的专项说明

4.24 管理人对基金投资策略的专项说明

4.25 管理人对基金投资策略的专项说明

4.26 管理人对基金投资策略的专项说明

4.27 管理人对基金投资策略的专项说明

4.28 管理人对基金投资策略的专项说明

4.29 管理人对基金投资策略的专项说明

4.30 管理人对基金投资策略的专项说明

4.31 管理人对基金投资策略的专项说明

4.32 管理人对基金投资策略的专项说明

4.33 管理人对基金投资策略的专项说明

4.34 管理人对基金投资策略的专项说明

4.35 管理人对基金投资策略的专项说明

4.36 管理人对基金投资策略的专项说明

4.37 管理人对基金投资策略的专项说明