

东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金

2017年第3季度报告

2017年09月30日

基金管理人:东兴证券股份有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2017年10月27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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年10月26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2017年07月01日起至2017年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 东兴众智优选混合 |
| 基金主代码 | 002465 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年06月13日 |
| 报告期末基金份额总额 | 142,830,491.44份 |
| 投资目标 | 本基金主要以行业、公司基本面研究为基础，精选具有估值优势和成长潜力的公司进行投资，力争获取超越业绩比较基准的收益，在严格控制下行风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金管理人采用主要以行业、公司基本面研究为基础，筛选具有估值优势和成长潜力的公司进行投资。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。 |
| 基金管理人 | 东兴证券股份有限公司 |

| | |
|-------|--------------|
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
|-------|--------------|

§ 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07月01日 - 2017年09月30日） |
|-----------------|--------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 11,543,246.63 |
| 2. 本期利润 | 8,238,740.99 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0494 |
| 4. 期末基金资产净值 | 148,269,965.82 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.038 |

注：1、本期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数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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 | 业绩比较基准收 益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|------------|---------------|----------------|-------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 5.38% | 0.56% | 2.71% | 0.35% | 2.67% | 0.21% |

3.2.2 自基金合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

东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年06月13日-2017年09月30日)



注：1、本基金基金合同生效日为2016年6月13日，建仓期为6个月，截至本报告期末距建仓期结束不满一年；

2、建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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 | | |
| 程远先生 | 本基金基金经理 | 2016-06-13 | - | 8年 | 学士，8年证券行业从业经验。2008年加入东兴证券投资银行总部工作，2009年任东兴证券研究所纺织服装行业高级研究员，2011年任华泰证券（原华泰联合）研究所纺织服装研究组组长，2013年任华泰证券纺织服装组组长兼任轻工造纸组和旅游酒店组组长，现任东兴证券基金业务部研究总监、投资决策委员会委员、东兴众智 |

| | | | | | |
|-------|---------|------------|------------|----|---|
| | | | | | 优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 李兵伟先生 | 本基金基金经理 | 2016-06-13 | 2017-07-03 | 6年 | 中央财经大学金融学硕士，6年以上证券行业从业经历，6年以上证券投研管理经验。2010年7月至2015年8月，任信达证券金融工程研究员、投资经理；2015年9月加入东兴证券股份有限公司基金业务部。现任东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金。 |
| 李晨辉先生 | 本基金基金经理 | 2016-06-13 | 2017-08-08 | 5年 | 中国科学院工学硕士，武汉大学学士，具有5年证券从业经验。2011年进入东兴证券研究所从事行业研究，历任行业研究员、高级行业研究员。2014年2月加入东兴证券基金部筹备组，主要负责跟踪计算机、软件等行业投资机会。现任东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证券监督管理委员会和《东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度以来，随着政策导向趋于友好，经济增长预期不断向上修正，上游企业盈利显著改善，股票市场的风险偏好出现了明显回升，各种热点此起彼伏。新能源汽车、人工智能、周期品、国企改革等多个领域同时发力，市场有效突破3300点并连续创出年内新高。前期持续萎靡的创业板三季度以来表现较好，其中前期跌幅较大的个股均出现明显的反弹。报告期内，上证综指、沪深300和创业板指数涨幅分别为4.90%、4.63%和2.69%。

报告期内，本基金根据市场情况，采取了灵活的操作策略，重点配置了京津冀、金融、新能源等板块。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2017年7月1日起至2017年9月30日，本基金份额净值增长率为5.38%，业绩比较基准收益率为2.71%，高于业绩比较基准2.67%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------|----------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 138,199,797.04 | 92.84 |
| | 其中：股票 | 138,199,797.04 | 92.84 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 10,525,480.73 | 7.07 |
| 8 | 其他资产 | 132,526.93 | 0.09 |
| 9 | 合计 | 148,857,804.70 | 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 | 公允价值(元) | 占基金资产净值的比例(%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 70,071,513.15 | 47.26 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 31,093.44 | 0.02 |
| E | 建筑业 | 11,834,842.20 | 7.98 |
| F | 批发和零售业 | 26,385.45 | 0.02 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 7,384,404.66 | 4.98 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 17,066,768.03 | 11.51 |
| J | 金融业 | 11,698,560.00 | 7.89 |
| K | 房地产业 | 8,142,625.80 | 5.49 |
| L | 租赁和商务服务业 | 79,324.72 | 0.05 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 7,460,100.00 | 5.03 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |

| | | | |
|---|-----------|----------------|-------|
| Q | 卫生和社会工作 | 115,299.99 | 0.08 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 40,879.60 | 0.03 |
| S | 综合 | 4,248,000.00 | 2.87 |
| | 合计 | 138,199,797.04 | 93.21 |

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 | 000018 | 神州长城 | 1,499,980 | 11,834,842.20 | 7.98 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 216,000 | 11,698,560.00 | 7.89 |
| 3 | 600438 | 通威股份 | 1,160,000 | 10,938,800.00 | 7.38 |
| 4 | 601700 | 风范股份 | 1,299,037 | 9,690,816.02 | 6.54 |
| 5 | 600634 | 中技控股 | 470,000 | 8,812,500.00 | 5.94 |
| 6 | 300248 | 新开普 | 480,000 | 8,236,800.00 | 5.56 |
| 7 | 002366 | 台海核电 | 290,000 | 8,218,600.00 | 5.54 |
| 8 | 002147 | 新光圆成 | 623,956 | 8,142,625.80 | 5.49 |
| 9 | 002102 | 冠福股份 | 1,980,000 | 7,801,200.00 | 5.26 |
| 10 | 300125 | 易世达 | 270,000 | 7,460,100.00 | 5.03 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注**5.11.1**

本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(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 79,714.86 |
| 2 | 应收证券清算款 | 49,397.82 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,414.25 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 132,526.93 |

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 177,760,289.43 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 96,099.48 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 35,025,897.47 |

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 142,830,491.44 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期本基金管理人未持有过本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--|----------------|------------------------|---------------|------|---------------|---------------|---------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比(%) |
| 机构 | 1 | 20170701-20170930 | 84,130,990.42 | - | 12,000,000.00 | 72,130,990.42 | 50.50 |
| | 2 | 20170701-20170930 | 62,221,400.43 | - | 21,000,000.00 | 41,221,400.43 | 28.86 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>1、本基金为混合型基金，基金资产主要投资于股票市场与债券市场，因此股市、债市的变化将影响到基金业绩表现。本基金股票投资占基金资产的比例为0-95%，在灵活调整资产配置比例时，不能完全抵御市场整体下跌风险，基金净值表现因此可能受到影响。本基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。此外，由于本基金还可以投资其他品种，这些品种的价格也可能因市场中的各类变化而出现一定幅度的波动，产生特定的风险，并影响到整体基金的投资收益。</p> <p>2、本基金可投资股指期货，股指期货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，股价指数微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。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。</p> <p>3、本基金开放期可能出现巨额赎回，导致基金资产变现困难，进而出现延缓支付赎回款项的风险。</p> | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金2017年第3季度报告原文

9.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦12层

9.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站(www.fund.dxzq.net)查阅。

东兴证券股份有限公司
二〇一七年十月二十七日