

东兴核心成长混合型证券投资基金2019年第1季度报告

2019-03-31
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：2019-04-22

重要提示

基金管理人承诺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2019年4月12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，也不保证最低收益。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。
本报告自2019年1月30日（基金合同生效日）起至2019年3月31日止。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数据 (Data). Includes fields like 基金简称, 场内简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 基金管理人, 基金托管人, 下属二级基金的基金简称, 下属二级基金的场内简称, 下属二级基金的交易代码, 报告期末下属二级基金的资产总额, 报告期末下属二级基金的风险收益特征.

主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 主基金(元) (Main Fund in Yuan). Includes 本期已实现收益, 本期利润, 加权平均基金份额本期利润, 期末基金资产净值, 期末基金份额净值.

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，计入费用后实际投资水平可能低于所列数字。

基金净值表现

Table with 2 columns: 阶段 (Period) and 净值增长率标准差② (Net Return Rate Standard Deviation 2). Includes 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, 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A.



注：本基金基金合同生效日为2019年1月30日，建仓期为6个月。截至报告期末，本基金合同生效不满六个月，仍处于在建期。

其他指标

Table with 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-01-30至2019-03-31) (Reporting Period). Includes 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-03-31).

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with 4 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理任期 (Term of Service as Fund Manager), 说明 (Remarks). Includes 程远先生 (Cheng Yuan).

注：1、对基金的前任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；对此类非前任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议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。

管理人对报告期内本基金运作遵信情况的说明

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，中国证监会《东兴核心成长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，本基金投资运作符合有关法律法规及基金合同的约定。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况
基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《东兴证券股份有限公司基金业务公平交易管理办法（附则）》。基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和系统的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在授权范围内公平交易。

异常交易行为的专项说明
本报告期内，未发现本基金有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异常公开竞价同日反向交易成交较多的单边交易数量超过该证券当日成交量5%的情况。

报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年初以来，A股市场受管理政策支持以及中美贸易谈判乐观预期影响，展开春季躁动行情，持续反弹。另外海外机构投资者一直看好消费蓝筹和金融股，年初以来一直维持净买入态势，而且买入金额创出新高。上证50、沪深300指数1月份表现较好，2月份在中小市值公司减持政策出台后，创业板大幅反弹。报告期内，上证综指、沪深300和创业板指数涨幅分别为23.90%、28.62%和35.43%。

报告期内基金的业绩表现

2019年1月30日（基金合同生效日）起至2019年3月31日，本基金A类份额净值增长率为30.26%，业绩比较基准收益率为14.33%，低于业绩比较基准15.93%。本基金A类份额净值增长率为0.6%，业绩比较基准收益率为16.33%，低于业绩比较基准15.73%。

报告期内基金持有人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份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千元的情况。

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额(元) (Amount in Yuan), 占基金总资产的比例(%) (Percentage of Total Assets). Includes 权益类投资, 其中：股票, 固定收益投资, 其中：债券, 资产支持证券, 衍生品投资, 买入返售金融资产, 其中：买断式回购的买入返售金融资产, 银行存款和结算备付金合计, 其他资产, 合计.

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Includes 农、林、牧、渔业, 采矿业, 制造业, 电力、热力、燃气及生产和服务业, 建筑业, 批发和零售业, 交通运输、仓储和邮政业, 住宿和餐饮业, 信息传输、软件和信息技术服务业, 金融业, 房地产业, 租赁和商务服务业, 科学研究和技术服务业, 水利、环境和公共设施管理业, 居民服务、修理和其他服务业, 教育, 卫生和社会工作, 文化、体育和娱乐业, 综合, 合计.

报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

Table with 4 columns: 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Includes 港股通.

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

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity in Shares), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Includes 600958, 000783.

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value). Includes 国家债券, 央行票据, 金融债券, 其中：政策性金融债, 企业债券, 企业短期融资券, 中期票据(可交换债), 同业存单, 其他, 合计.

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

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量(张) (Quantity in Tens of Thousands), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value).

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量(买/卖) (Position Size), 合约市值(元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

本基金投资股指期货的投资政策

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with 6 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量(买/卖) (Position Size), 合约市值(元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Description).

本期国债期货投资政策

受到调查以及处罚情况

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

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

其他资产构成

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount in Yuan). Includes 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 应收利息, 应收申购款, 其他应收款, 待摊费用, 其他, 合计.

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

开放式基金份额变动

Table with 4 columns: 项目 (Item), 东兴核心成长混合 (Dongxing Core Growth Mixed), 东兴核心成长混合A (Dongxing Core Growth Mixed A), 东兴核心成长混合C (Dongxing Core Growth Mixed C). Includes 基金合同生效日的基金份额总额, 报告期基金份额总额, 基金合同生效日至报告期期末基金总资产的增幅, 报告期末基金份额总额.

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 4 columns: 项目 (Item), 东兴核心成长混合 (Dongxing Core Growth Mixed), 东兴核心成长混合A (Dongxing Core Growth Mixed A), 东兴核心成长混合C (Dongxing Core Growth Mixed C). Includes 基金合同生效日管理人持有的基金份额, 基金合同生效日至报告期期末买入/申购的基金份额, 基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回的基金份额, 报告期末管理人持有的基金份额, 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例(%) (Percentage of Total Shares Held by Manager at End of Report Period).

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 5 columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Method), 交易日期 (Transaction Date), 交易金额(元) (Transaction Amount in Yuan), 交易费用 (Transaction Fee). Includes 合计 (Total).

报告期末发起式基金发起资金持有基金份额情况

Table with 5 columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares Held), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Held), 发起份额总数 (Total Shares Issued), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Issued), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Period for Issued Shares).

报告期内前十名持有基金份额比例达到或超过20%的情况

Table with 6 columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的期间 (Period when Proportion Reached or Exceeded 20%), 期初份额 (Beginning Shares), 申购份额 (Shares Purchased), 赎回份额 (Shares Redeemed), 持有份额 (Shares Held), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Shares Held).

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。报告期内，债券的变化对整体基金业绩表现。本基金跟踪投资组合基金资产的比重为60-80%。在采用跟踪投资组合基金资产的策略时，不能完全排除市场整体下跌风险，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、上市公司基本面和宏观政策的研究，持续优化组合配置，跟踪特定风险。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出现一定幅度的波动，产生特定的风险，并影响整体基金的投资收益。
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。
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，进而出现延期支付赎回款项的风险。

影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末影响投资者决策的其他重要信息。

备查文件目录

- 1. 东兴核心成长混合型证券投资基金基金合同
2. 东兴核心成长混合型证券投资基金托管协议
3. 东兴核心成长混合型证券投资基金2019年第一季度报告全文

存放地点

北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层

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印件或复印件。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.daxingfund.com）查阅。