东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:2018年10月25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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月22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2018年07月01日起至2018年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东兴量化多策略混合
基金主代码	003208
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10月27日
报告期末基金份额总额	16,638,449.05份
投资目标	本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用量化方法进行投资，通过量化分析手段甄选多种有效的投资策略,在投资过程中最大限度消除人为情绪波动对投资造成的扰动,通过多种量化策略的组合搭配以达到获取稳定Alpha组合并进行择时判断的效果,降低系统性及非系统性风险。
业绩比较基准	中证800指数收益率*65%+中证综合债券指数收益率*35%
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(2018年07月01日 - 2018年09月30日)
1.本期已实现收益	-1,621,999.16
2.本期利润	-1,184,402.53
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0695
4.期末基金资产净值	12,569,397.30
5.期末基金份额净值	0.7548

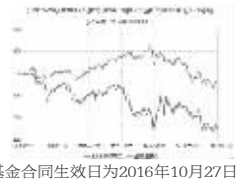
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-8.34%	1.18%	-1.84%	0.85%	-6.50%	0.33%

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



注:1、本基金基金合同生效日为2016年10月27日,根据相关法律法规和基金合同,本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内;
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	2017-11-16	-	9年	学士,9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管理研究总监、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、东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴兴利债券型证券投资基金基金经理。
李兵伟先生	本基金基金经理	2016-10-27	-	7年	中央财经大学金融学硕士,7年以上证券行业从业经历,7年以上证券投研管理经历,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基金经理、东兴量化优享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遵规守信情况的说明

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、中国证券监督管理委员会和《东兴量化多策略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

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(修订)》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法,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,在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易,基金管理人执行交易系统中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,在参与申购之前,各基金经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量。在获配额度确定后,部门应按照价格优先的原则对交易结果进行分配;如果申购价格相同,则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配。债券一级市场申购分配不足最小单位的,可由基金经理协商分配,协商不一致则由投资总监决定;对于银行间市场交易,应按照场外交易流程执行,由各基金经理给出询价区间,交易室根据询价区间在银行间市场上应该按照价格优先、时间优先的原则进行询价并完成交易,并留存询价交易记录备查。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析,投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

本报告期内,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合,未直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

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,政策面边际改善,货币政策明显放松,财政政策态度更加积极但尚未有实质性进展。宏观数据层面,投资放缓,消费疲软,出口走弱,对经济下行的预期逐步在数据上开始体现。美元指数的持续走高叠加美国国债利率的持续上升使得全球主要货币均出现较为明显的贬值,中美贸易摩擦仍存在较大不确定性。A股市场风险偏好持续下降,整体呈现弱势震荡走势。

本基金将根据市场态势积极调整因子组合适应市场,紧密跟踪市场趋势变化,结合主动管理策略,灵活进行仓位控制,力使基金表现不断变好。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2018年7月1日起至2018年9月30日,本基金份额净值增长率为-8.34%,业绩比较基准收益率为-1.84%,低于业绩比较基准6.50%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,受基金份额持有人赎回等影响,本基金存在基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情况,但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的情形,本基金管理人已将此情况上报中国证监会并将采取适当措施。

§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	8,866,392.08	69.76
	其中:股票	8,866,392.08	69.76
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	3,822,655.13	30.08
8	其他资产	21,288.83	0.17
9	合计	12,710,336.04	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

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,186,632.08	49.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	365,200.00	2.91
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	745,500.00	5.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,324,800.00	10.55
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	244,260.00	1.94
S	综合	-	-
	合计	8,866,392.08	70.60

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	002327	富安娜	128,900	1,037,645.00	8.26
2	002456	欧菲科技	47,100	635,379.00	5.06
3	603986	兆易创新	6,800	603,364.00	4.80
4	300545	联得装备	33,428	597,024.08	4.75
5	001979	招商蛇口	30,000	560,700.00	4.46
6	002293	罗莱生活	46,300	508,837.00	4.05
7	600418	江淮汽车	96,200	502,164.00	4.00
8	603816	顾家家居	10,000	498,000.00	3.97
9	000980	众泰汽车	92,600	494,484.00	3.94
10	300750	宁德时代	6,000	438,000.00	3.49

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	19,479.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	811.08
5	应收申购款	998.50
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	21,288.83

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	17,715,611.25
报告期期间基金总申购份额	180,859.24
减:报告期期间基金总赎回份额	1,258,021.44
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	16,638,449.05

§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
本报告期内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
本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。
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、东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同
2、东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议
3、东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金2018年第3季度报告原文
9.2 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
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
2018年10月25日

富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

基金管理人:	富国基金管理有限公司
基金托管人:	中国银行股份有限公司
报告送出日期:	2018年10月25日

§1 重要提示

富国基金管理有限公司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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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。
富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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。
本报告财务资料未经审计。
本报告期自2018年7月1日起至2018年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	富国中证娱乐主题指数增强型(LOF)
场内简称	娱乐增强
基金主代码	161036
交易代码	161036
基金运作方式	契约型,开放式。
基金合同生效日	2017年03月13日
报告期末基金份额总额(单位:份)	71,322,326.56
投资目标	本基金为增强型股票指数基金,在力求对中证娱乐主题指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值
投资策略	本基金以"指数化投资为主、主动性投资为辅",在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股,力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。本基金主要策略为复制目标指数,投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础,利用富国定量投资模型在有限范围内进行超配或低配选择。一方面将严格控制组合跟踪误差,避免大幅偏离目标指数,另一方面在指数跟踪的同时力求超越指数。
业绩比较基准	中证娱乐主题指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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(2018年07月01日-2018年09月30日)
1.本期已实现收益	-5,223,474.89
2.本期利润	-7,015,335.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0978
4.期末基金资产净值	44,350,404.11
5.期末基金份额净值	0.6218

注:上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(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
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。

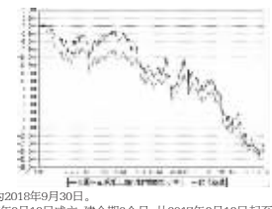
3.2 基金净值表现

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	-13.58%	1.39%	-11.65%	1.28%	-1.93%	0.11%

注:过去三个月指2018年7月1日-2018年9月30日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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:1、截止日期为2018年9月30日。
2、本基金于2017年3月13日成立,建仓期6个月,从2017年3月13日起至2017年9月12日,建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§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		
牛志冬	本基金基金经理	2017-03-13	-	11	硕士,自2007年7月至2010年8月任华夏基金管理有限公司研究员;自2010年8月至2012年4月任富国基金管理有限公司基金经理助理;自2012年4月至2015年3月任富国基金管理有限公司投资经理;自2015年5月起任富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金基金经理,自2016年11月起任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理,2017年3月起任富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理,2017年7月起任富国中证高端制造指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理,2017年11月起任富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理;兼任量化投资部量化投资副总监。具有基金从业资格。
徐幼华	本基金基金经理	2017-03-13	-	13	硕士,曾任上海京华创业投资有限公司投资经理助理;2006年7月至2008年12月任富国基金管理有限公司金融工程部数量研究员、2009年1月至2011年5月任富国基金管理有限公司另类投资部数量研究员、基金经理助理,2011年5月起任富国中证红利指数增强型证券投资基金基金经理,2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理,2015年6月至2017年12月任富国中证1证券400指数分级证券投资基金基金经理,2016年11月起任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理,2015年6月至2017年11月任富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理,2017年3月起任富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理,2017年4月起任富国中证高端制造指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理,2018年5月起任富国港股通量化精选股票型证券投资基金、富国中证1000指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理,2018年7月起任富国大众价值量化精选混合型证券投资基金基金经理,具有基金从业资格。

注:1、上述任职日期为根据公司决定确定的聘任日期,离任日期为根据公司决定确定的解聘日期;首任基金经理任职日期为基金合同生效日。
2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期,富国基金管理有限公司作为富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金(LOF)的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,以尽可能减少和分散投资风险、力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定收益为目标,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据相关法规要求,结合实际情况,制定了内部的《公平交易管理办法》,对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节,实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括:1、一级市场,通过标准化的办公流程,对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制;2、二级市场,通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理,对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制,银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为,非经特别控制流程审核同意,不得进行;对于同日同向交易,通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合,对同一投资标的采用相同投资策略的,必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令,确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估,以及不同时间窗口下(1日、3日、5日)的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统,对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估,分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品,并重点分析同类组合(股票型、混合型、债券型)间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为,若发现异常交易行为,风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释,并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字,并经督察长、总经理审阅签字后,归档保存,以备后查。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度,未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面,报告期内本组合与其他投资组合之间未出现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

7月上旬,中美双方分别对340亿美元进口商品进行征税。鉴于外部环境变化,宏观监管政策迎来微调。其中,央行、银保监会分别出台资管新规细则,在过渡期内对非标资产的清理不再一刀切,监管尺度有所放松。同时,国务院常委会决定实施更加积极的财政政策,银保监会鼓励银行加大对小微企业的贷款。受相关信息提振信心,市场迎来阶段性反弹。8月上旬,美国商务部宣布新增对44家中国军工企业技术封锁,同时美国政府宣布将对2000亿美元中国进口商品的惩罚性关税税率从之前建议的10%提高到25%。8月中旬,受土耳其汇率大幅贬值的影响,全球投资者对新兴市场陷入金融危机的担忧加剧,新兴市场整体跌幅较大,A股也再次下跌。9月中旬,国务院强调把已定减税降费措施切实落实到位,确保社保费现有征收政策稳定,并表态进一步支持民营企业的发展。同时,美国宣布自9月24日起对华2000亿美元输美商品加征10%关税,2019年1月1日起加征关税税率提高到25%。随着中美贸易摩擦阶段性靴子落地,A股开启反弹行情。总体来看,2018年3季度上证综指下跌0.92%,沪深300下跌2.05%,创业板指下跌12.16%。其中,中证娱乐主题指数2018年3季度下跌11.65%。

在投资管理上,我们坚持采取量化策略进行指数增强和风险管理,积极获取超额收益率。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期,本基金份额净值增长率为-13.58%,同期业绩比较基准收益率为-11.65%

4.6 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

1、本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
2、自2018年7月30日至本报告期末(2018年9月28日),本基金存在资产净值连续二十个工作日低于五千万元的情况。

§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	41,721,249.18	93.23
	其中:股票	41,721,249.18	93.23
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,988,976.64	6.68
7	其他资产	41,255.73	0.09
8	合计	44,751,481.56	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

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	60,724.00	0.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	506,239.00	1.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,178,042.00	2.66
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	520,199.00	1.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,840,224.20	6.40
S	综合	-	-
	合计	5,105,428.20	11.51

5.2.2 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,393,915.00	5.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	197,100.00	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	2,239,815.00	5.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,204,171.16	23.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,116,800.00	4.77
L	租赁和商务服务业	6,721,386.00	15.16
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	119,393.00	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	12,623,240.82	28.46
S	综合	-	-
	合计	36,615,820.98	82.56

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股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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	601888	中国国旅	64,200	4,366,884.00	9.85
2	000069	华侨城A	336,000	2,116,800.00	4.77
3	600138	中青旅	80,500	1,273,510.00	2.87
4	300418	昆仑万维	89,754	1,268,224.02	2.86
5	002602	世纪华通	44,900	1,255,853.00	2.83
6	600258	首旅酒店	61,980	1,255,095.00	2.83
7	002174	游族网络	74,300	1,202,917.00	2.71
8	300144	宋城演艺	52,600	1,170,350.00	2.64
9	300251	光线传媒	149,500	1,164,605.00	2.63
10	300182	捷成股份	204,200	1,151,688.00	2.60

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002343	慈文传媒	51,520	638,332.80	1.44
2	300467	迅游科技	24,700	602,680.00	1.36
3	600229	城市传媒	57,400	431,074.00	0.97
4	002445	中南文化	135,660	425,972.40	0.96
5	000719	中原传媒	56,600	422,236.00	0.95

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注: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
注: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。
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
注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。
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
注: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国债期货交易情况说明
5.9.1 本期国债期货投资政策
本基金报告期内未投资国债期货。
5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金报告期内未投资国债期货。
5.9.3 本期国债期货投资评价
本基金报告期内未投资国债期货。
5.10 投资组合报告附注
5.10.1
本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情况。
5.10.2
报告期内本基金投资的前十名股票中均在备选股票库内。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	30,715.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,816.013.43
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,846,728.82

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金报告期末无可转债。
5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金报告期末未持有股票。
5.10.6 报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限股票。
5.10.7 本期国债期货投资政策
本基金根据基金合同的约定,不允许投资国债期货。
5.10.8 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元)	-
国债期货投资本期收益(元)	-
国债期货投资本期公允价值变动(元)	-

注:本基金本报告期末未投资国债期货。
5.10.3 本期国债期货投资评价
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 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形。
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、处罚的情形。
5.11.2 申明本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。
报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	12,205.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	636.77
5	应收申购款	28,413.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,255.73

5.11.4 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。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002602	世纪华通	1,255,853.00	2.83	筹划重大事项

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末积极投资的五名股票中未持有流通受限股票。
5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。
因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	73,996,534.22
报告期期间基金总申购份额	4,120,239.45
减:报告期期间基金总赎回份额	6,794,447.11
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	71,322,326.56

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	-
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金