

(上接B9版)

本基金通过对经济发展过程中的制度性、结构性或周期性变化的研究和分析,深入挖掘潜在的投资主题,并选择那些受益于投资主题的公司进行投资。首先,从经济体制变革、产业结构调整等各个角度出发,分析经济结构、产业结构和企业经营方式变化带来的机会及风险,并以此为基础,分析经济运行的主要矛盾,从而前瞻性把握经济发展过程中的投资主题;其次,通过对投资主题的全面分析和评估,明确投资主题对应的主题企业或板块,从而确定受主题影响的关键公司;依据企业投资主题的敏感程度、反应速度以及获利水平等因素,精选个股;再次,通过主题投资发展趋势及其内在驱动因素的分析,不断地跟踪和研究新主题的出现,并及时调整投资方向以捕捉其投资机会,从而准确把握主题投资的最佳时机,充分分享主题投资兴起带来的投资收益。

(3)定向增发策略  
定向增发是指上市公司特定投资者(包括大股东、机构投资者、自然人)等非公开发行的融资方式。本基金将对发行非公开发行的上市公司进行基本面分析,结合市场未来走势进行判断,从战略角度评估参与定向增发公司的投资价值,预期损益和风险评估,分析增发对估值提升的增量贡献,在定向增发股票申购期结束后,本基金根据定向增发票内在投资价值和市场环境的变化,选择适当的时机卖出。

(4)动量策略  
动量策略是指市场在一定时期内可呈现“强者恒强”的特征,通过买入过去一段时期内涨势较佳以超越市场平均水平的股票。本基金将综合分析各股票的市场价格走势、动量特征、估值水平、行业景气度、换手率、市场交易活跃度、波动率,选择动量特征明显且估值合理的个股纳入投资组合,作为本基金的投资策略。

(5)固定收益类资产配置策略  
固定收益投资在保证资产流动性的基础上,采取利率预期策略、信用风险管理和时机策略相结合的积极投资策略,力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。

(1)利率预期与久期策略  
本基金密切跟踪宏观经济数据和金融运行数据,分析宏观经济运行的可能情景,预测财政政策、货币政策等对宏观经济政策的影响,分析金融市场资金供求状况变化趋势,在此基础上预期市场利率水平变动趋势,以及收益率曲线变化趋势,在预期市场利率水平上升时,降低组合的久期,预期市场利率将下降时,提高组合的久期,并根据收益率曲线变化情况确定相应的债券组合期限结构策略,如子弹型组合、蝶形组合或者梯形组合等。

(2)个券选择策略  
在个券选择方面,对各个品种进行详细的财务分析和财务分析后,进行个券选择,财务分析方面,以企业财务报表为依据,对企业规模、资产负债结构、偿债能力和盈利能力四方面进行分析;非财务分析方面(包括管理能力、市场地位和发展前景等指标)则主要通过实地调研和会议等形式实现。

(3)时机策略  
本基金将在严格控制风险的前提下进行权益投资,权益投资将以价值分析为基础,在采用量化模型分析其合理定价的基础上,结合权益的溢价率、隐含波动率、到期日等指标,选择权益的买入和卖出时机,追求在风险可控的前提下实现稳定的超额收益。

九、业绩比较基准  
本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%  
本基金选择该业绩基准,是基于以下因素:  
(1)沪深300指数和上证国债指数编制方法合理、透明;  
(2)沪深300指数和上证国债指数编制和发布有一定的历史,有较高的知名度和市场影响力;  
(3)具有市场覆盖率,不易被操纵;  
(4)本基金的股票、债券和现金比例,选用该业绩比较基准能够真实反映本基金

信息披露

的风险收益特征。  
沪深300指数由中证指数有限公司编制和计算,中证指数的编制采取一切必要措施以确保指数的精确性。关于指数值或成分股名称的所有知识产权均归中证指数有限公司。  
上证国债指数由上海证券交易所委托中证指数有限公司管理。上证指数的所有权归上海证券交易所。  
如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票时,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

十一、基金信息披露特征  
本基金是混合类证券投资基金,其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金,低于股票型基金产品,属于中高风险、中高收益的基金产品。  
基金管理人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法律责任。  
基金管理人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月18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。  
本报告中财务资料未经审计,本投资组合报告所载数据截至2018年6月30日。

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	361,829,137.82	90.54
2	固定收益投资	361,829,137.82	90.54
3	买入返售金融资产	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	其他资产	16,763,846.70	4.27
7	合计	399,673,921.54	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的港股投资股票组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	220,216,898.95	55.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	24,433,024.00	6.14
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	46,671,190.88	11.73
J	金融业	58,334,936.00	14.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	12,020,302.80	3.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.02
O	医药制造业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计		361,829,137.82	90.58

信息披露

2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合  
本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。  
3 报告期末公允价值占基金资产净值比例大于10%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	000858	五粮液	360,757	27,417,520.00	6.89
2	601138	中国平安	461,800	27,822,244.00	6.80
3	300059	东方财富	1,933,600	25,484,800.00	6.41
4	002024	苏宁易购	1,735,200	24,433,024.00	6.14
5	600990	汾西电子	238,368	19,683,360.00	4.99
6	600030	中信证券	1,104,900	18,308,130.00	4.60
7	601233	福耀玻璃	983,680	16,398,969.60	4.26
8	000830	鲁西化工	985,600	16,834,080.00	4.23
9	600426	华鲁恒升	871,868	15,336,158.12	3.86
10	600967	内蒙一机	1,052,249	13,465,652.28	3.37

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 报告期末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。  
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。  
7 报告期末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。  
8 报告期末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。  
9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有股指期货合约。  
9.2 本基金股指期货投资的投资政策  
本基金暂不投资股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
10.1 本期国债期货投资政策  
本基金暂不投资国债期货。  
10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货合约。  
10.3 本期国债期货投资情况  
本基金本报告期末未持有国债期货合约。

11 投资组合报告附注  
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、处罚的情况。  
11.2 报告期内,本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。  
11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	376,021.54
2	应收证券清算款	16,375,262.60
4	应收利息	5,394.13
5	应收申购款	7,271.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,763,846.70

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。  
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。  
11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分  
由于计算五天的原因,本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十一、基金的业绩  
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

(一)基金业绩表现  
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 净值增长率 净值增长率	业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准	业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准	①-③	②-④
2016年12月31日至 2016年12月31日	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2017年1月1日至2017年12月31日	8.28%	0.82%	11.92%	0.35%	-3.64%
2018年1月1日至2018年3月31日	10.98%	1.50%	-1.14%	0.63%	12.12%
2018年4月1日至2018年6月30日	-10.06%	1.33%	-4.86%	0.63%	-5.20%
2016年12月31日至 2018年6月30日	8.09%	1.00%	5.27%	0.47%	2.82%

注:①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,计入费用后实际收益水平要低于所列数据;  
②本基金选择沪深300指数作为股指期货投资的业绩基准,选择上证国债指数作为债券投资的业绩基准,复合业绩比较基准为:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%;  
③根据本基金合同约定的规定,本基金自2016年12月31日起与市场上开放式公募基金(LOF)  
财多策略精选混合型证券投资基金(LOF)  
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12月31日-2018年6月30日)

注:①本基金合同生效日为2015年7月1日,转型日期为2016年12月31日;  
②根据《基金合同》约定,本基金投资于股票资产占基金净值,30%-95%,债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种的合计为基金净值的0%-70%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。基金管理人已于前一个工作日调整完毕。本基金建仓期是2015年7月1日至2016年6月30日,自建仓期起按照中国证监会《关于发布《证券投资基金流通受限股票估值指引(试行)》的通知》(中基协发〔2017〕6号)确定的估值方法对持有的流通受限股票进行调整。

十三、基金费用与税收  
(一)基金费用的种类  
1、基金管理人的管理费;  
2、基金托管人的托管费;  
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费、律师费和诉讼费;  
5、基金份额持有人大会费用;  
6、基金的证券交易费用;  
7、基金的银行汇划费用;  
8、基金的上市费用及《基金合同》约定,在相关基金财产中列支的其他费用。  
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,在相关基金财产中列支的其他费用。  
(二)基金费用的计提、计提标准和支付方式  
1、基金管理人的管理费  
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法

信息披露

本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
7 报告期末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。  
8 报告期末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。  
9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有股指期货合约。  
9.2 本基金股指期货投资的投资政策  
本基金暂不投资股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
10.1 本期国债期货投资政策  
本基金暂不投资国债期货。  
10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货合约。  
10.3 本期国债期货投资情况  
本基金本报告期末未持有国债期货合约。

11 投资组合报告附注  
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、处罚的情况。  
11.2 报告期内,本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。  
11.3 其他资产构成

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。  
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。  
11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分  
由于计算五天的原因,本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十一、基金的业绩  
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

(一)基金业绩表现  
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 净值增长率 净值增长率	业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准	业绩比较基准 业绩比较基准 业绩比较基准	①-③	②-④
2016年12月31日至 2016年12月31日	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
2017年1月1日至2017年12月31日	8.28%	0.82%	11.92%	0.35%	-3.64%
2018年1月1日至2018年3月31日	10.98%	1.50%	-1.14%	0.63%	12.12%
2018年4月1日至2018年6月30日	-10.06%	1.33%	-4.86%	0.63%	-5.20%
2016年12月31日至 2018年6月30日	8.09%	1.00%	5.27%	0.47%	2.82%

注:①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,计入费用后实际收益水平要低于所列数据;  
②本基金选择沪深300指数作为股指期货投资的业绩基准,选择上证国债指数作为债券投资的业绩基准,复合业绩比较基准为:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%;  
③根据本基金合同约定的规定,本基金自2016年12月31日起与市场上开放式公募基金(LOF)  
财多策略精选混合型证券投资基金(LOF)  
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12月31日-2018年6月30日)

注:①本基金合同生效日为2015年7月1日,转型日期为2016年12月31日;  
②根据《基金合同》约定,本基金投资于股票资产占基金净值,30%-95%,债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种的合计为基金净值的0%-70%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。基金管理人已于前一个工作日调整完毕。本基金建仓期是2015年7月1日至2016年6月30日,自建仓期起按照中国证监会《关于发布《证券投资基金流通受限股票估值指引(试行)》的通知》(中基协发〔2017〕6号)确定的估值方法对持有的流通受限股票进行调整。

十三、基金费用与税收  
(一)基金费用的种类  
1、基金管理人的管理费;  
2、基金托管人的托管费;  
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费、律师费和诉讼费;  
5、基金份额持有人大会费用;  
6、基金的证券交易费用;  
7、基金的银行汇划费用;  
8、基金的上市费用及《基金合同》约定,在相关基金财产中列支的其他费用。  
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,在相关基金财产中列支的其他费用。  
(二)基金费用的计提、计提标准和支付方式  
1、基金管理人的管理费  
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法

本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
7 报告期末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。  
8 报告期末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。  
9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有股指期货合约。  
9.2 本基金股指期货投资的投资政策  
本基金暂不投资股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
10.1 本期国债期货投资政策  
本基金暂不投资国债期货。  
10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货合约。  
10.3 本期国债期货投资情况  
本基金本报告期末未持有国债期货合约。

11 投资组合报告附注  
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、处罚的情况。  
11.2 报告期内,本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。  
11.3 其他资产构成

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。  
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。  
11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分  
由于计算五天的原因,本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十一、基金的业绩  
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

(一)基金业绩表现  
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

注:①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,计入费用后实际收益水平要低于所列数据;  
②本基金选择沪深300指数作为股指期货投资的业绩基准,选择上证国债指数作为债券投资的业绩基准,复合业绩比较基准为:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%;  
③根据本基金合同约定的规定,本基金自2016年12月31日起与市场上开放式公募基金(LOF)  
财多策略精选混合型证券投资基金(LOF)  
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12月31日-2018年6月30日)

注:①本基金合同生效日为2015年7月1日,转型日期为2016年12月31日;  
②根据《基金合同》约定,本基金投资于股票资产占基金净值,30%-95%,债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种的合计为基金净值的0%-70%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。基金管理人已于前一个工作日调整完毕。本基金建仓期是2015年7月1日至2016年6月30日,自建仓期起按照中国证监会《关于发布《证券投资基金流通受限股票估值指引(试行)》的通知》(中基协发〔2017〕6号)确定的估值方法对持有的流通受限股票进行调整。

十三、基金费用与税收  
(一)基金费用的种类  
1、基金管理人的管理费;  
2、基金托管人的托管费;  
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费、律师费和诉讼费;  
5、基金份额持有人大会费用;  
6、基金的证券交易费用;  
7、基金的银行汇划费用;  
8、基金的上市费用及《基金合同》约定,在相关基金财产中列支的其他费用。  
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,在相关基金财产中列支的其他费用。  
(二)基金费用的计提、计提标准和支付方式  
1、基金管理人的管理费  
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法

信息披露

本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
7 报告期末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。  
8 报告期末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。  
9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有股指期货合约。  
9.2 本基金股指期货投资的投资政策  
本基金暂不投资股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
10.1 本期国债期货投资政策  
本基金暂不投资国债期货。  
10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货合约。  
10.3 本期国债期货投资情况  
本基金本报告期末未持有国债期货合约。

11 投资组合报告附注  
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、处罚的情况。  
11.2 报告期内,本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。  
11.3 其他资产构成

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。  
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。  
11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分  
由于计算五天的原因,本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十一、基金的业绩  
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

(一)基金业绩表现  
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

注:①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,计入费用后实际收益水平要低于所列数据;  
②本基金选择沪深300指数作为股指期货投资的业绩基准,选择上证国债指数作为债券投资的业绩基准,复合业绩比较基准为:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%;  
③根据本基金合同约定的规定,本基金自2016年12月31日起与市场上开放式公募基金(LOF)  
财多策略精选混合型证券投资基金(LOF)  
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12月31日-2018年6月30日)

注:①本基金合同生效日为2015年7月1日,转型日期为2016年12月31日;  
②根据《基金合同》约定,本基金投资于股票资产占基金净值,30%-95%,债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种的合计为基金净值的0%-70%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。基金管理人已于前一个工作日调整完毕。本基金建仓期是2015年7月1日至2016年6月30日,自建仓期起按照中国证监会《关于发布《证券投资基金流通受限股票估值指引(试行)》的通知》(中基协发〔2017〕6号)确定的估值方法对持有的流通受限股票进行调整。

十三、基金费用与税收  
(一)基金费用的种类  
1、基金管理人的管理费;  
2、基金托管人的托管费;  
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费、律师费和诉讼费;  
5、基金份额持有人大会费用;  
6、基金的证券交易费用;  
7、基金的银行汇划费用;  
8、基金的上市费用及《基金合同》约定,在相关基金财产中列支的其他费用。  
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,在相关基金财产中列支的其他费用。  
(二)基金费用的计提、计提标准和支付方式  
1、基金管理人的管理费  
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法

本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
7 报告期末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。  
8 报告期末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。  
9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有股指期货合约。  
9.2 本基金股指期货投资的投资政策  
本基金暂不投资股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
10.1 本期国债期货投资政策  
本基金暂不投资国债期货。  
10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货合约。  
10.3 本期国债期货投资情况  
本基金本报告期末未持有国债期货合约。

11 投资组合报告附注  
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、处罚的情况。  
11.2 报告期内,本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。  
11.3 其他资产构成

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。  
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。  
11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分  
由于计算五天的原因,本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十一、基金的业绩  
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

(一)基金业绩表现  
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

注:①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,计入费用后实际收益水平要低于所列数据;  
②本基金选择沪深300指数作为股指期货投资的业绩基准,选择上证国债指数作为债券投资的业绩基准,复合业绩比较基准为:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%;  
③根据本基金合同约定的规定,本基金自2016年12月31日起与市场上开放式公募基金(LOF)  
财多策略精选混合型证券投资基金(LOF)  
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12月31日-2018年6月30日)

注:①本基金合同生效日为2015年7月1日,转型日期为2016年12月31日;  
②根据《基金合同》约定,本基金投资于股票资产占基金净值,30%-95%,债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种的合计为基金净值的0%-70%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。基金管理人已于前一个工作日调整完毕。本基金建仓期是2015年7月1日至2016年6月30日,自建仓期起按照中国证监会《关于发布《证券投资基金流通受限股票估值指引(试行)》的通知》(中基协发〔2017〕6号)确定的估值方法对持有的流通受限股票进行调整。

十三、基金费用与税收  
(一)基金费用的种类  
1、基金管理人的管理费;  
2、基金托管人的托管费;  
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费、律师费和诉讼费;  
5、基金份额持有人大会费用;  
6、基金的证券交易费用;  
7、基金的银行汇划费用;  
8、基金的上市费用及《基金合同》约定,在相关基金财产中列支的其他费用。  
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,在相关基金财产中列支的其他费用。  
(二)基金费用的计提、计提标准和支付方式  
1、基金管理人的管理费  
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法

# 海南大东海旅游中心股份有限公司

## 2018 半年度 报告摘要

证券代码:000613.200613 证券简称:大东海.A.大东海B 公告编号:2018-055

一、重要提示  
本半年度报告摘要来自半年度报告全文,为全面了解本公司的经营成果、财务状况及未来发展规划,投资者应当到指定信息披露网站仔细阅读半年度报告全文。  
董事、监事、高级管理人员声明:无  
非标准审计意见提示  
□适用√不适用  
董事会审议的报告期普通股利润分配预案或公积金转增股本预案  
□适用√不适用  
公司计划不派发现金红利,不送红股,不以公积金转增股本。  
董事会决议通过的本报告期优先股利润分配预案  
□适用√不适用  
二、主要财务数据和财务指标  
公司是否