

# 东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年 度报告摘要

2018 年 06 月 30 日

基金管理人:东兴证券股份有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

送出日期:2018 年 08 月 29 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年08月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告期自2018年02月09日（基金合同生效日）起至2018年06月30日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                |
|------------|----------------|
| 基金简称       | 东兴量化优享混合       |
| 基金主代码      | 004696         |
| 基金运作方式     | 契约型开放式         |
| 基金合同生效日    | 2018年02月09日    |
| 基金管理人      | 东兴证券股份有限公司     |
| 基金托管人      | 兴业银行股份有限公司     |
| 报告期末基金份额总额 | 64,986,672.66份 |
| 基金合同存续期    | 不定期            |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金通过数量化的方法寻找具有价值优势且具有一定市值的股票，力争在控制风险的基础上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具有优质价值且具有一定市值的股票，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。  |
| 业绩比较基准 | 中证800指数收益率*50%+中证综合债券指数收益率*50%  |
| 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。          |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      | 基金管理人      | 基金托管人                 |
|---------|------------|-----------------------|
| 名称      | 东兴证券股份有限公司 | 兴业银行股份有限公司            |
| 信息披露负责人 | 姓名         | 陈智勇                   |
|         | 联系电话       | 010-66551816          |
|         | 电子邮箱       | chenzy_jj@dxzq.net.cn |
| 客户服务电话  | 95309      | 95561                 |

|    |              |              |
|----|--------------|--------------|
| 传真 | 010-66551452 | 021-62159217 |
|----|--------------|--------------|

## 2.4 信息披露方式

|                          |                         |
|--------------------------|-------------------------|
| 登载基金半年度报告正文的<br>管理人互联网网址 | www.fund.dxzq.net       |
| 基金半年度报告备置地点              | 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦12层 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

|                      |  |
|----------------------|--|
| <b>3.1.1 期间数据和指标</b> | 报告期（2018年02月09日（基金合同生效日）- 2018年06月30日） |
| 本期已实现收益              | -212,425.02                            |
| 本期利润                 | -605,932.25                            |
| 本期基金份额净值增长率          | -1.39%                                 |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 报告期末（2018年06月30日）                      |
| 期末基金资产净值             | 64,086,463.16                          |
| 期末基金份额净值             | 0.9861                                 |

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、期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

3、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。

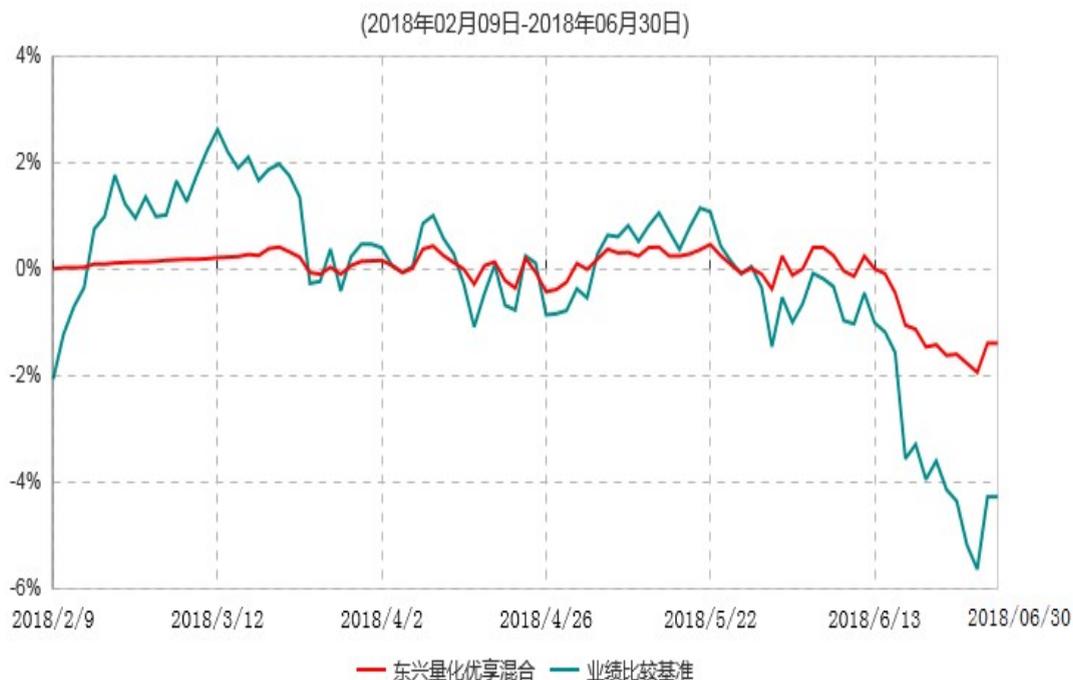
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 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         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月      | -1.64%   | 0.28%       | -3.74%     | 0.69%         | 2.10% | -0.41% |
| 过去三个月      | -1.55%   | 0.25%       | -4.61%     | 0.58%         | 3.06% | -0.33% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.39%   | 0.20%       | -4.15%     | 0.61%         | 2.76% | -0.41% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

东兴量化优享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



注：本基金基金合同生效日为2018年2月9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，仍处于建仓期。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

东兴证券股份有限公司（股票简称“东兴证券”，股票代码“601198”，以下简称“本公司”）是2008年经财政部和中国证监会批准，由中国东方资产管理股份有限公司作为主要发起人发起设立的全国性综合类证券公司，2015年2月26日在上海证券交易所上市，是国内首家资产管理公司系上市证券公司。

本公司注册资本27.58亿元，总部设在北京。公司业务涵盖证券经纪、证券投资咨询、与证券交易和证券投资活动有关的财务顾问、证券承销与保荐、证券投资基金销售业务、证券自营和证券资产管理业务、融资融券业务、代销金融产品业务、公开募集证券投资基金管理业务，形成覆盖场内与场外、线下和线上、国内和海外的综合金融服务体系。

本公司经中国证券监督管理委员会核准（证监许可【2015】67号）于2015年1月8日

获得公开募集证券投资基金管理业务资格。截至2018年6月30日，本公司管理东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金、东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金、东兴安盈宝货币市场基金、东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、东兴兴利债券型证券投资基金、东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金共7只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名    | 职务      | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-------|---------|-----------------|------|--------|--|
|       |         | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 孙继青先生 | 本基金基金经理 | 2018-02-09      | -    | 10年    | 北京科技大学工学硕士，3年钢铁行业经验，10年证券行业经验。2007年10月加入东兴证券，2007年10月至2012年3月任东兴证券研究所钢铁行业研究员；2012年3月至2013年6月任东兴证券资产管理部投资品行业研究员、宏观策略研究员；2013年6月至2014年9月任东兴证券资产管理部投资经理。2014年9月加入东兴证券基金业务部。现任东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴安盈宝货币市场基金基金经理、东兴兴利债券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。 |
| 李兵伟先生 | 本基金基金经理 | 2018-02-09      | -    | 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《东兴量化优享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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 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内的公平交易程序；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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年经济预期发生了较大变化，无论对经济或者市场都相对乐观，但由于国内去杠杆，同时美国持续加息，美国股市从高位回落，国内市场也冲高回落，二季度，去杠杆持续发力，企业债务违约增加，再加上美国加息预期和中美贸易摩擦的影响，市场普遍担忧经济下滑，虽然货币政策有所变化，也进行了降准操作，但外汇贬值、股市大幅下跌，今年上半年上证指数、沪深300、创业板指数涨幅分别是-13.90%、-12.90%、-8.33%。

今年上半年市场经历了较大的变化，先是蓝筹股大幅上涨，创业板大幅回调，随后美国股市回调带动大盘蓝筹大幅回调，在随后反弹中代表新兴经济的创业板大幅反弹，但是由于中美贸易摩擦加剧，特别是美国制裁中兴，为国内科技企业蒙上了一层阴影，创业板指数再次大幅下跌，随后房地产政策影响、市场股权质押和汇率贬值的影响，大盘蓝筹、消费和地产产业链相关公司也出现了大跌，A股市场出现了明显调整。

市场大幅波动，为降低风险，本基金成立之初仓位较低，截止上半年，本基金成立以来净值0.9861，下跌-1.39%，大幅跑赢沪深300指数。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自本基金合同生效日（2018年2月9日）起至2018年6月30日，本基金份额净值增长率为-1.39%，业绩比较基准收益率为-4.15%，高于业绩比较基准2.76%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018年三季度，经济仍可能小幅下滑，但经济高质量发展将成为未来长期趋势，短期内去杠杆收到一定效果，货币政策发生微调，虽然目前中美贸易有摩擦，但政策会继续加大改革开放，市场经历了短期快速调整之后，估值水平已经处于历史较低水平。我国目前处于经济转型期，各种改革正持续不断的推进，无论是国企改革和政治经济改革方面都将逐步迎来收获期，也为投资者创造更好的投资机遇。

企业盈利维持较好水平，改革收获期，估值相对较低，我们对后市并不悲观。未来一段时间本基金仍将以价值投资为导向，精选一些低估值、良好盈利能力和充分受益于改革推进的优质企业进行投资。国家支持新经济的情况下，未来新经济也具有较好的战略配置价值。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期末进行利润分配。

#### 4.8 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

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 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

| 资 产         | 本期末<br>2018年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| <b>资 产：</b> |                    |
| 银行存款        | 11,043,739.81      |
| 结算备付金       | 320,114.95         |
| 存出保证金       | 17,718.62          |
| 交易性金融资产     | 29,974,700.00      |
| 其中：股票投资     | 11,930,300.00      |
| 基金投资        | -                  |
| 债券投资        | 18,044,400.00      |
| 资产支持证券投资    | -                  |
| 贵金属投资       | -                  |
| 衍生金融资产      | -                  |
| 买入返售金融资产    | 31,000,000.00      |
| 应收证券清算款     | -                  |
| 应收利息        | 233,436.62         |

|                 |                    |
|-----------------|--------------------|
| 应收股利            | -                  |
| 应收申购款           | -                  |
| 递延所得税资产         | -                  |
| 其他资产            | -                  |
| 资产总计            | 72,589,710.00      |
| <b>负债和所有者权益</b> | 本期末<br>2018年06月30日 |
| <b>负 债:</b>     |                    |
| 短期借款            | -                  |
| 交易性金融负债         | -                  |
| 衍生金融负债          | -                  |
| 卖出回购金融资产款       | -                  |
| 应付证券清算款         | 8,000,000.00       |
| 应付赎回款           | 374,121.24         |
| 应付管理人报酬         | 37,986.30          |
| 应付托管费           | 5,426.60           |
| 应付销售服务费         | 5,426.60           |
| 应付交易费用          | 32,372.46          |
| 应交税费            | -                  |
| 应付利息            | -                  |
| 应付利润            | -                  |
| 递延所得税负债         | -                  |
| 其他负债            | 47,913.64          |
| 负债合计            | 8,503,246.84       |
| <b>所有者权益:</b>   |                    |
| 实收基金            | 64,986,672.66      |
| 未分配利润           | -900,209.50        |
| 所有者权益合计         | 64,086,463.16      |
| 负债和所有者权益总计      | 72,589,710.00      |

注：1、报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.9861元，基金份额总额64,986,672.66份。

2、本基金基金合同于2018年2月9日生效，无可比期间数据。本报告实际报告期为2018年2月9日至2018年6月30日。

## 6.2 利润表

会计主体：东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年02月09日（基金合同生效日）至2018年06月30日

单位：人民币元

| 项 目                    | 本期2018年02月09日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |
|------------------------|------------------------------------|
| <b>一、收入</b>            | -93,689.30                         |
| 1. 利息收入                | 1,294,542.79                       |
| 其中：存款利息收入              | 838,671.00                         |
| 债券利息收入                 | 225,664.65                         |
| 资产支持证券利息收入             | -                                  |
| 买入返售金融资产收入             | 230,207.14                         |
| 其他利息收入                 | -                                  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      | -994,731.74                        |
| 其中：股票投资收益              | -1,165,740.63                      |
| 基金投资收益                 | -                                  |
| 债券投资收益                 | -500.00                            |
| 资产支持证券投资收益             | -                                  |
| 贵金属投资收益                | -                                  |
| 衍生工具收益                 | -                                  |
| 股利收益                   | 171,508.89                         |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -393,507.23                        |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -                                  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.88                               |
| <b>减：二、费用</b>          | 512,242.95                         |

|                     |             |
|---------------------|-------------|
| 1. 管理人报酬            | 298,388.12  |
| 2. 托管费              | 42,626.84   |
| 3. 销售服务费            | 42,626.84   |
| 4. 交易费用             | 77,941.11   |
| 5. 利息支出             | -           |
| 其中：卖出回购金融资产支出       | -           |
| 6. 税金及附加            | -           |
| 7. 其他费用             | 50,660.04   |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -605,932.25 |
| 减：所得税费用             | -           |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   | -605,932.25 |

注：本基金基金合同于2018年2月9日生效，无可比期间数据。本报告实际报告期为2018年2月9日至2018年6月30日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年02月09日（基金合同生效日）至2018年06月30日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2018年02月09日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |             |                 |
|--|--|-------------|-----------------|
|  | 实收基金                                   | 未分配利润       | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 225,914,216.89                         | -           | 225,914,216.89  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                      | -605,932.25 | -605,932.25     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -160,927,544.23                        | -294,277.25 | -161,221,821.48 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 48,175.11                              | -72.98      | 48,102.13       |
| 2. 基金赎回款                               | -160,975,719.34                        | -294,204.27 | -161,269,923.61 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                      | -           | -               |

|                 |               |             |               |
|-----------------|---------------|-------------|---------------|
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 64,986,672.66 | -900,209.50 | 64,086,463.16 |
|-----------------|---------------|-------------|---------------|

注：本基金基金合同于2018年2月9日生效，无可比期间数据。本报告实际报告期为2018年2月9日至2018年6月30日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

魏庆华

魏庆华

王青

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2017年5月10日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]677号）的批复，自2018年1月15日起至2018年2月6日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集225,905,088.67元人民币，业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）“德师报(验)字(18)第00082号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2018年2月9日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为225,914,216.89份，其中认购资金利息折合9,128.22份。本基金基金管理人为东兴证券股份有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、权证、股指期货、货币市场工具、同业存单、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

如果法律法规变更或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》（财政部令第33号发布、财政部令第76号修订）、于2006年2月15日及其后颁布和修订的41项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第3号—半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号—年度报告和半年度报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号—会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年2月9日（基金合同生效日）至2018年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策与上年度会计报表相一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。本期财务报表的实际编制期间为2018年2月9日（基金合同生效日）至2018年6月30日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## 2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券以及不作为有效套期工具的衍生工具等，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以成本进行后续计量，在摊销时产生的利得或损失，应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

股票投资成本按交易日股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

## (2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转债，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于债券部分的成本。

买入零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含报酬率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

## (3) 权证投资

权证投资于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转债而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

## (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

## (5) 买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始成本。买入返售金融资产于返售到期日按账面余额结转。

## (6) 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始成本。卖出回购金融资产款于回购到期日按账面余额结转。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券(包括股票、权证等)，以其估值日在证券交易所挂牌

的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价或第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去债券收盘价或估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

（4）交易所上市不存在活跃市场的非固定收益类有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，以第三方估值机构提供的价格数据估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### （1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

##### （2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

### (3) 公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

### (4) 其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则登记机构将以投资者在各销售机构最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回

的基金份额享受当次分红；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税【2002】128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税【2004】78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税【2007】84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税【2008】1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年4月23日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008年9月18日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、财税【2015】101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税【2016】36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税【2016】70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》、财税【2016】140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税【2017】2号《财政部、国家税务总局关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税【2017】56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。自2018年1月1日起，在基金运营过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2. 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入，自2015年9月8日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事A股买卖，自2008年09月19日起，由出让方按0.1%的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 6.4.7 关联方关系

##### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称      | 与本基金的关系                 |
|------------|-------------------------|
| 东兴证券股份有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构     |
| 兴业银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构            |
| 大连银行股份有限公司 | 与基金管理人同一控股股东的关联方、基金销售机构 |

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2018年02月09日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |              |
|------------|--|--------------|
|            | 成交金额                                   | 占当期股票成交总额的比例 |
| 东兴证券股份有限公司 | 64,973,372.66                          | 100.00%      |

注：本基金基金合同于2018年2月9日生效，无可比期间数据。本报告实际报告期为2018年2月9日至2018年6月30日。

#### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2018年02月09日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |                |
|------------|--|----------------|
|            | 成交金额                                   | 占当期债券买卖成交总额的比例 |
| 东兴证券股份有限公司 | 40,014,700.00                          | 100.00%        |

注：本基金基金合同于2018年2月9日生效，无可比期间数据。本报告实际报告期为2018年2月9日至2018年6月30日。

#### 6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2018年02月09日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |                |
|------------|--|----------------|
|            | 成交金额                                   | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 东兴证券股份有限公司 | 266,000,000.00                         | 100.00%        |

注：本基金基金合同于2018年2月9日生效，无可比期间数据。本报告实际报告期为2018年2月9日至2018年6月30日。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年02月09日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |        |       |         |
|-------|--|--------|-------|---------|
|       | 当期佣                                    | 占当期佣金总 | 期末应付佣 | 占期末应付佣金 |
|       |  |        |       |         |

|                | 金             | 量的比例    | 金余额       | 总额的比例   |
|----------------|---------------|---------|-----------|---------|
| 东兴证券股份有限公<br>司 | 46,215<br>.95 | 100.00% | 32,372.46 | 100.00% |

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

3、本基金基金合同于2018年2月9日生效，无可比期间数据。本报告实际报告期为2018年2月9日至2018年6月30日。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2018年02月09日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |
|-----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 298,388.12                             |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 39,212.25                              |

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、本基金基金合同于2018年2月9日生效，无可比期间数据。本报告实际报告期为2018年2月9日至2018年6月30日。

##### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018年02月09日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |
|----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 42,626.84                              |

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金基金合同于2018年2月9日生效，无可比期间数据。本报告实际报告期为2018年2月9日至2018年6月30日。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2018年02月09日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |
|----------------|--|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                       |
| (销售服务费用)关联方名称  | 当期应支付的销售服务费                            |
| 东兴证券股份有限公司     | 30,557.73                              |
| 兴业银行股份有限公司     | 8,813.94                               |
| 大连银行股份有限公司     | 2,630.78                               |
| 合计             | 42,002.45                              |

注：1、本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本基金基金合同于2018年2月9日生效，无可比期间数据。本报告实际报告期为2018年2月9日至2018年6月30日。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                          | 本期<br>2018年02月09日（<br>基金合同生效日）<br>至2018年06月30日 |
|-----------------------------|--|
| 基金合同生效日（2018年02月09日）持有的基金份额 | 7,999,000.00                                   |
| 报告期初持有的基金份额                 | 7,999,000.00                                   |
| 报告期间申购/买入总份额                | -  |
| 报告期间因拆分变动份额                 | -  |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额              | -  |
| 报告期末持有的基金份额                 | 7,999,000.00                                   |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例         | 12.31%   |

注：本基金基金合同于2018年2月9日生效，无可比期间数据。本报告实际报告期为2018年2月9日至2018年6月30日。

##### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2018年02月09日（基金合同生效日）至2018年06月30日 |            |
|------------|--|------------|
|            | 期末余额                                   | 当期利息收入     |
| 兴业银行股份有限公司 | 11,043,739.81                          | 184,002.57 |

注：本基金基金合同于2018年2月9日生效，无可比期间数据。本报告实际报告期为2018年2月9日至2018年6月30日。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项的说明。

#### 6.4.9 期末（2018年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目     | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资   | 11,930,300.00 | 16.44         |
|    | 其中：股票  | 11,930,300.00 | 16.44         |
| 2  | 基金投资   | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资 | 18,044,400.00 | 24.86         |
|    | 其中：债券  | 18,044,400.00 | 24.86         |
|    | 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          | 31,000,000.00 | 42.71  |
|   | 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      | 11,363,854.76 | 15.65  |
| 8 | 其他各项资产            | 251,155.24    | 0.35   |
| 9 | 合计                | 72,589,710.00 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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         | 660,600.00   | 1.03         |
| B  | 采矿业              | 1,038,400.00 | 1.62         |
| C  | 制造业              | 6,485,742.00 | 10.12        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 727,000.00   | 1.13         |
| E  | 建筑业              | -            | -            |
| F  | 批发和零售业           | -            | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 765,000.00   | 1.19         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,661,900.00 | 2.59         |
| J  | 金融业              | 591,658.00   | 0.92         |
| 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    | -            | -            |
| 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 | -             | -     |
| S | 综合        | -             | -     |
|   | 合计        | 11,930,300.00 | 18.62 |

### 7.3 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

金额单位：人民币元

| 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  | 002029 | 七匹狼  | 160,000 | 1,278,400.00 | 1.99         |
| 2  | 002415 | 海康威视 | 30,000  | 1,113,900.00 | 1.74         |
| 3  | 300059 | 东方财富 | 80,000  | 1,054,400.00 | 1.65         |
| 4  | 600104 | 上汽集团 | 30,000  | 1,049,700.00 | 1.64         |
| 5  | 600028 | 中国石化 | 160,000 | 1,038,400.00 | 1.62         |
| 6  | 002157 | 正邦科技 | 200,000 | 814,000.00   | 1.27         |
| 7  | 000895 | 双汇发展 | 30,000  | 792,300.00   | 1.24         |
| 8  | 000089 | 深圳机场 | 100,000 | 765,000.00   | 1.19         |
| 9  | 600886 | 国投电力 | 100,000 | 727,000.00   | 1.13         |
| 10 | 300498 | 温氏股份 | 30,000  | 660,600.00   | 1.03         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.fund.dxzq.net](http://www.fund.dxzq.net) 网站的半年度报告正文。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 600028 | 中国石化 | 3,030,359.00 | 4.73           |
| 2  | 000977 | 浪潮信息 | 1,858,395.00 | 2.90           |
| 3  | 000002 | 万科A  | 1,569,124.03 | 2.45           |
| 4  | 002029 | 七匹狼  | 1,445,950.00 | 2.26           |
| 5  | 000725 | 京东方A | 1,395,000.00 | 2.18           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 6  | 600566 | 济川药业 | 1,386,788.00 | 2.16 |
| 7  | 601318 | 中国平安 | 1,386,610.00 | 2.16 |
| 8  | 000756 | 新华制药 | 1,295,797.00 | 2.02 |
| 9  | 000786 | 北新建材 | 1,221,248.00 | 1.91 |
| 10 | 601398 | 工商银行 | 1,203,000.00 | 1.88 |
| 11 | 002415 | 海康威视 | 1,182,749.95 | 1.85 |
| 12 | 601888 | 中国国旅 | 1,130,022.00 | 1.76 |
| 13 | 601111 | 中国国航 | 1,114,700.00 | 1.74 |
| 14 | 600409 | 三友化工 | 1,053,990.00 | 1.64 |
| 15 | 601800 | 中国交建 | 1,051,042.00 | 1.64 |
| 16 | 601877 | 正泰电器 | 1,041,000.00 | 1.62 |
| 17 | 300059 | 东方财富 | 1,026,826.00 | 1.60 |
| 18 | 600104 | 上汽集团 | 980,412.00   | 1.53 |
| 19 | 002352 | 顺丰控股 | 938,328.84   | 1.46 |
| 20 | 601688 | 华泰证券 | 894,145.00   | 1.40 |

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

2、“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额     | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 600028 | 中国石化 | 2,055,000.00 | 3.21           |
| 2  | 000977 | 浪潮信息 | 1,785,860.58 | 2.79           |
| 3  | 000002 | 万科A  | 1,376,497.00 | 2.15           |
| 4  | 000725 | 京东方A | 1,280,349.88 | 2.00           |
| 5  | 000756 | 新华制药 | 1,203,062.00 | 1.88           |
| 6  | 601877 | 正泰电器 | 1,159,384.00 | 1.81           |
| 7  | 000786 | 北新建材 | 1,155,000.00 | 1.80           |
| 8  | 601398 | 工商银行 | 1,126,000.00 | 1.76           |
| 9  | 601888 | 中国国旅 | 1,048,136.90 | 1.64           |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 10 | 601111 | 中国国航  | 1,024,110.00 | 1.60 |
| 11 | 601800 | 中国交建  | 1,002,300.00 | 1.56 |
| 12 | 600566 | 济川药业  | 962,585.00   | 1.50 |
| 13 | 002352 | 顺丰控股  | 961,049.24   | 1.50 |
| 14 | 600409 | 三友化工  | 893,577.00   | 1.39 |
| 15 | 002511 | 中顺洁柔  | 872,744.00   | 1.36 |
| 16 | 601688 | 华泰证券  | 855,531.00   | 1.33 |
| 17 | 600029 | 南方航空  | 848,600.00   | 1.32 |
| 18 | 601988 | 中国银行  | 756,400.00   | 1.18 |
| 19 | 000501 | 鄂武商 A | 736,847.80   | 1.15 |
| 20 | 000858 | 五粮液   | 683,100.00   | 1.07 |

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票  
2、“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |               |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 39,246,560.26 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 25,726,812.40 |

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 8,006,400.00  | 12.49        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 10,038,000.00 | 15.66        |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,038,000.00 | 15.66        |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |

|    |           |               |       |
|----|-----------|---------------|-------|
| 6  | 中期票据      | -             | -     |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -     |
| 8  | 同业存单      | -             | -     |
| 9  | 其他        | -             | -     |
| 10 | 合计        | 18,044,400.00 | 28.16 |

#### 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 018005 | 国开1701 | 100,000 | 10,038,000.00 | 15.66        |
| 2  | 019585 | 18国债03 | 80,000  | 8,006,400.00  | 12.49        |
| 3  | -      | -      | -       | -             | -            |
| 4  | -      | -      | -       | -             | -            |
| 5  | -      | -      | -       | -             | -            |

#### 7.7 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。

#### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 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。

#### 7.10 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。

#### 7.11 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。

#### 7.12 投资组合报告附注

##### 7.12.1

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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额         |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 17,718.62  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 233,436.62 |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 251,155.24 |

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构        |        |               |        |
|----------|-----------|--------------|--------|---------------|--------|
|          |           | 机构投资者        |        | 个人投资者         |        |
|          |           | 持有份额         | 占总份额比例 | 持有份额          | 占总份额比例 |
| 1,110    | 58,546.55 | 8,994,204.88 | 13.84% | 55,992,467.78 | 86.16% |

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 15,583.63 | 0.02%    |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金 | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2018年02月09日)基金份额总额 | 225,914,216.89 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额      | 48,175.11      |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额    | 160,975,719.34 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额     | -              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 64,986,672.66  |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、东兴证券股份有限公司（以下简称“公司”）第四届董事会第八次会议于2018年2月5日在北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层第一会议室以现场和电话方式举行，审议通过《关于选举董事会专门委员会委员的议案》。鉴于独立董事朱武祥先生和韩建旻先生任期届满不再连任，公司2017年第二次临时股东大会选举宫肃康先生和孙广亮先生为公司第四届董事会独立董事，宫肃康先生和孙广亮先生均已获得中国证券监督管理委员会北京证监局证券公司独立董事任职资格。根据《公司法》、《公司

章程》规定，董事会选举宫肃康先生为公司第四届董事会审计委员会主任委员、薪酬与提名委员会委员、风险控制委员会委员；选举孙广亮先生为公司第四届董事会发展战略委员会委员、审计委员会委员。

2、2018年2月10日，公司发布公告称近日，东兴证券股份有限公司（以下简称“公司”）收到公司董事邵晓怡女士递交的书面辞职报告。因个人工作调整，邵晓怡女士申请辞去第四届董事会董事、董事会审计委员会委员和薪酬与提名委员会委员。

3、东兴证券股份有限公司（以下简称“公司”）第四届董事会第十次会议于2018年5月25日在北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层第一会议室以现场和电话方式举行，审议通过《关于提请股东大会选举公司第四届董事会非独立董事的议案》，公司股东山东高速股份有限公司拟变更派出董事，提名王云泉先生为公司第四届董事会非独立董事候选人。董事会同意提请股东大会选举王云泉先生为公司第四届董事会非独立董事。王云泉先生已获得北京证监局证券公司董事任职资格，在其获股东大会选举为董事后，张震先生将不再担任公司董事。

4、2018年6月13日，公司发布公告称东兴证券股份有限公司（以下简称“公司”）董事会近日收到公司副总经理孙小庆先生的书面辞呈，孙小庆先生因工作原因申请辞去公司副总经理，以及在公司及控股子公司兼任的一切职务。根据公司章程规定，孙小庆先生的辞职自辞呈送达董事会时生效。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、本基金管理人因未按规定办理2015年至2016年度直接投资存量权益登记，2018年3月21日，国家外汇管理局北京外汇管理部对公司出具行政处罚决定书（京汇简罚【2018】042号），责令公司改正，给予警告，并处1000元人民币的罚款。公司已完成整改。

2、除上述情形外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称       | 交易单元数量 | 股票交易          |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
|            |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 东兴证券股份有限公司 | 2      | 64,973,372.66 | 100.00%      | 46,215.95 | 100.00%    | -  |

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

#### 2、交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强的证券公司。其中财务状况良好、经营行为规范以最近一年证券公司分类评介在C类或C类以上，且近一年内无重大违法违规事件为主要判断依据。研究实力较强以公司基金业务部投研团队的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

3、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能在租赁其他证券公司的交易单元，只能使用本基金管理人自有的交易单元

4、本基金本报告期内未新增交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称       | 债券交易          |              | 债券回购交易         |                | 权证交易 |              | 基金交易 |              |
|------------|---------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|            | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额           | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 东兴证券股份有限公司 | 40,014,700.00 | 100.00%      | 266,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

东兴证券股份有限公司

二〇一八年八月二十九日