

财通多策略福瑞定期开放混合型发起式证券投资基金2018年第2季度报告

2018年06月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司

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07月20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。

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。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	财通福瑞定开混合发起
场内简称	财通福瑞
基金主代码	501028
交易代码	501028
基金运作方式	上市契约型、定期开放。本基金以定期开放方式运作，即本基金在一定期间内封闭运作，不接受基金的申购、赎回；在封闭期结束和下一封闭期开始之间设置开放期，受理本基金的申购、赎回等申请。
基金合同生效日	2016年11月22日
报告期末基金份额总额	1,302,052,440.39份
投资目标	本基金将灵活运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金综合分析国内外政治经济环境、经济基本面状况、宏观政策变化、金融市场形势等多方面因素，通过对货币市场、债券市场和股票市场的整体估值状况比较分析，对各主要投资品种市场的未来发展趋势进行研判，根据判断结果进行资产配置及组合的构建，确定基金在

	<p>股票、债券、货币市场工具等资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态调整各资产类别的投资比例，在控制投资组合整体风险基础上力争提高收益。</p> <p>本基金在价值投资理念的基础上，建立成长策略、主题策略、定向增发策略以及动量策略等多策略体系，并根据市场环境的变化进行针对性运用；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性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益；在严格控制风险的前提下进行权证投资；根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p>
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%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，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	财通基金管理有限公司
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04月01日 - 2018年06月30日）
--------	--------------------------------

1.本期已实现收益	-143,063,354.46
2.本期利润	-167,383,258.14
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0764
4.期末基金资产净值	1,095,586,885.70
5.期末基金份额净值	0.8414

注：(1)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；

(2)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

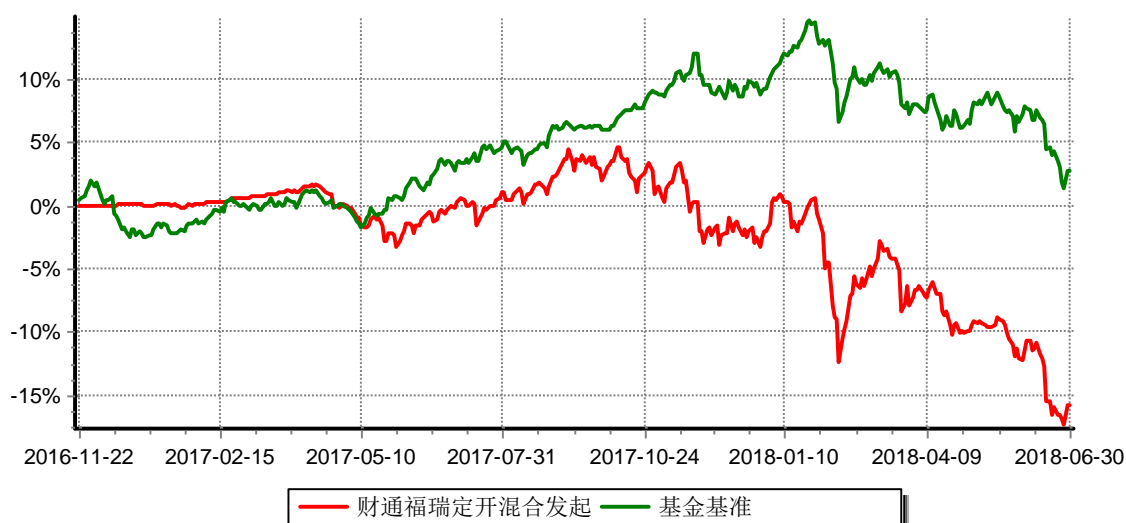
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.88%	0.73%	-4.86%	0.63%	-5.02%	0.10%

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字；

(2)本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

3.2.2 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

财通多策略福瑞定期开放混合型发起式证券投资基金
 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11月22日-2018年6月30日）



注：(1)本基金合同生效日为2016年11月22日；

(2)根据《基金合同》规定：封闭期内，股票资产比例为基金资产的30%~100%；开放期内，股票资产的比例为基金资产的0~95%。但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前一个月及开放期结束后一个月的封闭期内，基金股票资产的比例不受上述30%~100%的限制。开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货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不低于基金资产净值的5%。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金建仓期是2016年11月22日至2017年5月22日，截至建仓期末及报告期末，本基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

(3)本基金自2017年9月8日起根据中国证券投资基金业协会《关于发布<证券投资基金投资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。

§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		
姚思劼	本基金的基金经理	2016年11月22日	-	7年	复旦大学管理学硕士。2011年7月加入财通基金管理有限公司，历任助理研究员、研究员，研究行业覆盖汽车、机械、公用事业等，重点关注高端装备制造等战略新兴产业，现任基金投资部的基金经理。

注：(1)基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，其"离职日期"为根据公司决议

确定的解聘日期；

(2)非首任基金经理，其"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；

(3)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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人以价值投资为理念，致力于建设合理的组织架构和科学的投资决策体系，营造公平交易的执行环境。公司通过严格的内控制度和授权体系，确保投资、研究、交易等各个环节的独立性。公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易，并建立了公平的交易分配制度，确保在场内、场外各类交易中，各投资组合都享有公平的交易执行机会。

同时，公司逐步建立健全公司各投资组合均可参考的投资对象备选库和交易对手备选库，在此平台上共享研究成果，并对各组合提供无倾向性支持；在公用备选库的基础上，各投资组合经理根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库，进而根据投资授权构建具体的投资组合。在确保投资组合间信息隔离、权限明晰的基础上，形成信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中适当启用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后等环节，特殊情况会经过严格的报告和审批程序，会定期针对旗下所有组合的交易记录进行了交易时机和价差的专项统计分析，以排查异常交易。

报告期内，本基金参与上市公司定向增发项目，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通基金管理有限公司公平交易制度》的规定，未发现组合间存在违背公平交易原则的行为或异常交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合及短期国债回购交易除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。

如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型基金。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易（短期国债回购交易除外）的情况，也未发生影响市场价格的临近日同向或反向交易。

经过事前制度约束、事中严密监控，以及事后的统计排查，本报告期内各笔交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明，本期基金运作未对市场产生有违公允性的影响，亦未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年宏观经济整体运行相对稳定，进入二季度以后受到国内去杠杆和国际贸易战的双重影响，开始呈现一定的压力，并对资本市场产生影响。二季度整体市场在经济基本面和流动性紧张的双重压力下，出现了较大幅度的调整，2017年度整体表现强势的金融、地产、消费等行业以及以创业板为代表的成长股板块相继出现了较大幅度下跌，市场呈现出风险偏好下行的态势。

本基金于二季度完成了定期开放申购、赎回工作，进入第二个封闭期后，基于对宏观经济的整体把握和对市场风格的判断，对投资组合持续进行调整优化，通过对行业及公司基本面的深入分析和合理的价值评估，我们在报告期内均衡配置景气度提升的行业板块，从中优选行业龙头和综合竞争力提升的公司，努力获得超额收益。未来市场将更加注重上市公司经营业绩的稳定性和持续性，更多关注泛消费类行业板块，从中优选细分领域龙头企业，同时兼顾以生物制药、云计算、人工智能、高端制造为代表的新兴成长领域，从中挖掘具有核心竞争力和高经营壁垒的优质企业。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金基金份额净值为0.8414元；本报告期内，基金份额净值增长率为-9.88%，同期业绩比较基准收益率为-4.86%。

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，本基金未有连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情况出现。

§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	744,468,691.07	67.76
	其中：股票	744,468,691.07	67.76

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	232,481.91	0.02
	其中：债券	232,481.91	0.02
	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	264,536,636.81	24.08
	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	58,539,629.07	5.33
8	其他资产	30,897,308.20	2.81
9	合计	1,098,674,747.06	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)	占基金资产净值的比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	142,943,956.05	13.05
C	制造业	355,553,593.81	32.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,130,808.29	5.31
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,424,506.92	1.50
G	交通运输、仓储和邮政业	12,938,932.72	1.18
H	住宿和餐饮业	43,061,776.89	3.93
I	信息传输、软件和信息技术服务业	64,407,663.53	5.88
J	金融业	36,615,872.00	3.34
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	81,226.14	0.01

	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	14,310,354.72	1.31
S	综合	-	-
	合计	744,468,691.07	67.95

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。

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	601899	紫金矿业	29,139,425	99,679,107.50	9.10
2	601689	拓普集团	2,817,824	52,791,932.64	4.82
3	601718	际华集团	11,938,030	44,924,213.92	4.10
4	600258	首旅酒店	1,688,349	43,061,776.89	3.93
5	600167	联美控股	4,301,996	39,793,463.00	3.63
6	600063	皖维高新	9,672,903	24,472,444.59	2.23
7	600339	中油工程	5,680,893	23,462,088.09	2.14
8	000778	新兴铸管	5,776,699	23,337,863.96	2.13
9	002611	东方精工	3,753,888	21,322,083.84	1.95
10	601318	中国平安	359,800	21,077,084.00	1.92

注：本基金报告期末持有紫金矿业(601899)、拓普集团(601689)、际华集团(601718)、首旅酒店(600258)上市流通及流通受限部分，上表中按同一股票合并计算，具体信息详见本报告5.11.5。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

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）	232,481.91	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	232,481.91	0.02

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	123006	东财转债	1,933	232,481.91	0.02

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

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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、处罚的情形。

根据上市公司公告，本基金投资的前十名证券中际华集团（证券代码：601718）收到北京证监局下发的《关于对际华集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定（[2017]155号）》，并进行整改。拓普集团（证券代码：601689）于2017年7月21日收到宁波证监局下发的《关于对宁波拓普集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（[2017]18号），并进行整改。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	621,211.30
2	应收证券清算款	30,076,701.55
3	应收股利	-
4	应收利息	199,395.35
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,897,308.20

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	123006	东财转债	232,481.91	0.02

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	601899	紫金矿业	68,212,903.50	6.23	非公开发行解禁后限售
2	601718	际华集团	40,961,904.94	3.74	非公开发行解禁后限售
3	600167	联美控股	39,793,463.00	3.63	非公开发行解禁后限售
4	600258	首旅酒店	32,543,862.34	2.97	非公开发行解禁后限售
5	601689	拓普集团	25,402,683.36	2.32	非公开发行解禁后限售
6	600063	皖维高新	24,472,444.59	2.23	非公开发行解禁后限售
7	600339	中油工程	23,462,088.09	2.14	非公开发行解禁后限售
8	000778	新兴铸管	23,337,863.96	2.13	非公开发行解禁后限售
9	002611	东方精工	21,322,083.84	1.95	非公开发行解禁后限售/ 重大事项临时停牌

注：根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》要求（下称《规定》），持有上市公司非公开发行股份的股东，采取集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%，且自股份解除限售之日起12个月内，减持数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的50%；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。上述通过非公开发行方式获得的股份已过限售期的，但根据《规定》要求需于一定时间内继续处于限售状态。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	3,082,380,658.22
报告期期间基金总申购份额	55,513.71
减：报告期期间基金总赎回份额	1,780,383,731.54
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	1,302,052,440.39

注：(1)总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额；

(2) 本基金以定期开放方式运作，即本基金在一定期间内封闭运作，不接受基金的申购、赎回；在封闭期结束和下一封闭期开始之间设置开放期，受理本基金的申购、赎回等申请。

§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	10,001,250.00
------------------	---------------

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	10,001,250.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.77%

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额	交易金额	适用费率
1	认购	2016年11月22日	10,001,250.00	10,000,000.00	0.01%
合计			10,001,250.00	10,000,000.00	

注：基金管理人运用固有资金10,000,000.00元作为发起式资金认购本基金，认购费用为1,000.00元，表格中按照固定费用折合成小数计算。募集期产生的利息为2,250.00元。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,250.00	0.77%	10,001,250.00	0.77%	3年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	
基金经理等人员	—	—	—	—	
基金管理人股东	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	10,001,250.00	0.77%	10,001,250.00	0.77%	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	2018-05-22至 2018-06-30	300,05 3,000. 00	0	0	300,053,00 0.00	23.04%
产品特有风险							
<p>在投资管理中会至少维持30%的股票投资比例，不能完全规避市场下跌的风险和个股风险，在市场上涨时也不能保证基金净值能够完全跟随或超越市场涨幅；在股票资产配置上，本基金主要运用成长、主题、定向增发、动量等多种策略精选个股，而市场整体并不全部符合本基金的选股标准。在特定的投资期间之内，本基金的收益率可能会与市场整体产生偏差；基金经理主观判断错误的风险；本基金以定期开放方式运作，在本基金的封闭期内，基金份额持有人将无法按照基金份额净值进行申购和赎回；本基金的投资范围包括股指期货，期货是一种复杂的投资工具，期货合约价值取决于基础资产价格变动等诸多因素，并且远期价格与即期价格不时背离，该等因素均无法为基金管理人准确判断，因此委托资产投资期货可能由于基金管理人判断错误而导致损失，且基金管理人该种判断错误是不可克服和不可避免的</p> <p>在报告期内，本基金单一投资者持有的基金份额已超过20%，可能对基金运作造成如下风险：</p> <p>(1)赎回申请延缓支付的风险</p> <p>该等投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与该等投资者按同比例延缓支付赎回款项的风险。</p> <p>(2)基金净值大幅波动的风险</p> <p>该等投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；</p> <p>(3)基金规模过小导致的风险</p> <p>该等投资者赎回后，很可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，实现基金投资目标存在一定的不确定性。</p>							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，公司根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，在《上海证券报》、《中国证券报》及管理人网站进行了如下信息披露：

1、2018年04月03日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中泰证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

2、2018年04月12日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东海证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

3、2018年04月17日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下基金增加代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告》；

4、2018年04月19日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下投资组合调整停牌股票估值方法的公告》；

5、2018年04月20日披露了《财通多策略福瑞定期开放混合型发起式证券投资基金2018年第1季度报告》；

6、2018年04月25日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下投资组合调整停牌股票估值方法的公告》；

7、2018年05月04日披露了《财通多策略福瑞定期开放混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》；

8、2018年05月17日披露了《财通多策略福瑞定期开放混合型发起式证券投资基金开放日常转换业务的公告》；

9、2018年05月18日披露了《北京首旅酒店(集团)股份有限公司简式权益变动报告书》；

10、2018年05月19日披露了《关于旗下部分开放式基金在代销机构开通基金转换业务的公告》；

11、2018年05月22日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银河证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

12、2018年05月22日披露了《际华集团股份有限公司简式权益变动报告》；

13、2018年05月22日披露了《债券投资交易人员公示债券投资交易人员公示》；

14、2018年06月02日披露了《关于旗下部分开放式基金在上海银行股份有限公司开通基金转换业务的公告》；

15、2018年06月23日披露了《上海龙宇燃油股份有限公司简式权益变动报告书》；

16、2018年06月30日披露了《财通多策略福瑞定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书（2018年第1号）》及其摘要；

17、2018年06月30日披露了《财通基金管理有限公司高级管理人员变更公告》；

18、2018年07月02日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下基金2018年半年度资产净值的公告》；

19、2018年07月02日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下基金2018年半年度资产净值的公告》；

20、本报告期内，公司按照《信息披露管理办法》的规定定期公布基金份额净值和基金份额累计净值。

21、中国证券监督管理委员会于2017年5月27日发布《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》（下称“《规定》”），同日，沪深交易所分别就《规定》出具相关实施细则。《规定》及相关实施细则就大股东和参与非公开发行股票获配股东的减持行为，在信息披露、持有期限、减持限制等做出了进一步规定，该等规定在防范“违规减持”、“无序减持”等行为，引导和促进价值投资、长期投资，保障资本市场稳定等方面应会发挥积极作用，但短期内一定程度上会限制非公开发行股份解禁后的卖出时间。

《规定》要求上市公司大股东及持有上市公司非公开发行股份的股东，采取集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%；采

取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%，大宗交易受让方在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。其中持有上市公司非公开发行股份的股东通过集中竞价交易减持该部分股份的，自股份解除限售之日起12个月内，还需满足减持数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的50%的规定。

本基金持有的非公开发行股份的减持需严格遵守《规定》要求，敬请投资者注意投资风险。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、财通多策略福瑞定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、财通多策略福瑞定期开放混合型发起式证券投资基金基金托管协议；
- 4、财通多策略福瑞定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书及其更新；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

10.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心41楼。

10.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：<http://www.ctfund.com>

财通基金管理有限公司

二〇一八年七月二十日