

财通可持续发展主题股票型证券投资基金2014年半年度报告

2014年6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

送出日期：2014年8月28日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 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。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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年8月20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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

### 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
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	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50
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	50
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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§9 开放式基金份额变动	52
§10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53

10.4	基金投资策略的改变.....	53
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	54
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8	其他重大事件.....	55
§11	备查文件目录.....	56
11.1	备查文件目录.....	56
11.2	存放地点.....	57
11.3	查阅方式.....	57

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	财通可持续发展主题股票型证券投资基金
基金简称	财通可持续股票
场内简称	—
基金主代码	000017
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2013年3月27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
报告期末基金份额总额	46,684,484.51份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在可持续发展的投资理念下，通过系统化评估方法精选出可持续发展特征突出的上市公司进入投资视野，并选择具有估值优势的股票进行实际投资，在有效控制风险的前提下，力争为投资者创造超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金采用定性与定量分析相结合的方法，通过对货币、债券和股票市场的整体估值状况比较分析，进行资产配置及组合的构建；行业配置策略上，根据宏观经济周期、行业生命周期、行业结构升级、宏观和产业政策等的变化情况，投资时钟理论，货币和财政政策的变化对行业的影响，结合行业自身估值水平，借助数量化方法筛选出预期能够获得超额收益的行业。本基金以企业的可持续发展特征评估为股票选择的基础，以企业的综合性成长评估为股票选择的增强因素，精选具有估值优势的个股；在保证资产流动性的基础上，债券投资采取利率预期策略、信用风险管理和时机策略相结合的积极性投资方法；权证投资以价值分析为基础，采用数量化模型分析其合理定价，结合权

	证的溢价率、隐含波动率、到期日等指标，选择买入和卖出时机；在股指期货投资中根据风险管理原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下参与投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只主动型股票基金，属于具有较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，预期风险与预期收益均高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

### 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	财通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄惠
	联系电话	021-68886666
	电子邮箱	service@ctfund.com
客户服务电话	400-820-9888	95588
传真	021-68888321	010-66105798
注册地址	上海市虹口区吴淞路619号 505室	北京市西城区复兴门内大街 55号
办公地址	上海市浦东新区银城中路68 号时代金融中心41楼	北京市西城区复兴门内大街 55号
邮政编码	200120	100032
法定代表人	阮琪	姜建清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》、《证券日报》
登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址	<a href="http://www.ctfund.com">http://www.ctfund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	财通基金管理有限公司	上海市银城中路68号时代金融中心41楼

### §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

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2014年1月1日至2014年6月30日）
本期已实现收益	3,243,365.31
本期利润	6,510,643.18
加权平均基金份额本期利润	0.1791
本期加权平均净值利润率	14.37%
本期基金份额净值增长率	16.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	11,598,702.51
期末可供分配基金份额利润	0.2484
期末基金资产净值	59,923,983.77
期末基金份额净值	1.284
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	35.63%

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)期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### 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

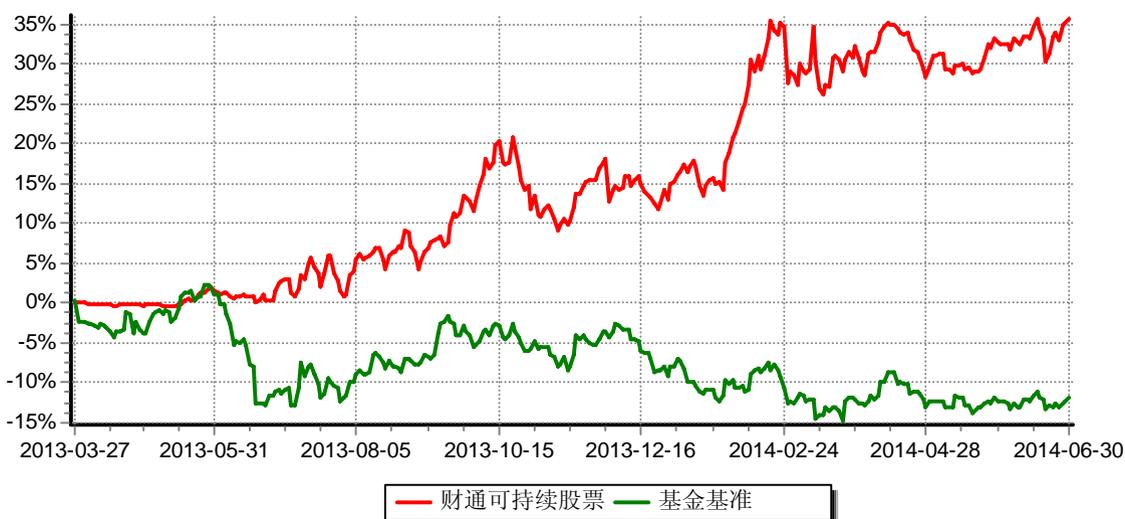
过去一个月	2.31%	0.91%	0.40%	0.62%	1.91%	0.29%
过去三个月	5.51%	0.77%	0.95%	0.70%	4.56%	0.07%
过去六个月	16.72%	1.20%	-5.27%	0.83%	21.99%	0.37%
过去一年	35.08%	1.19%	-0.47%	0.94%	35.55%	0.25%
自基金合同生效日起 至今（2013年03月27 日-2014年06月30日）	35.63%	1.07%	-11.98%	0.99%	47.61%	0.08%

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)本基金选择沪深300指数作为股票投资部分的业绩基准，选择上证国债指数作为债券投资部分的业绩基准，复合业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

### 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

财通可持续发展主题股票型证券投资基金份额  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2013年3月27日-2014年6月30日)



注：（1）本基金合同生效日为2013年3月27日；

（2）本基金投资于股票资产占基金资产：60%-95%；投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律或中国证监会允许基金投资的其他证券品种的比例占基金资产：5%-40%，其中，权证占基金资产净值：≤3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值：≥5%。本基金的建仓期为2013年3月27日至2013年9月27日；本基金通过认购非公开发行股票的方式，持有光正集团（股票代码“002524.SZ”）流通受限股份，限售期限为12个

月，于2014年4月28日上市流通，现光正集团由于筹划重大资产重组及其他资产收购事项，自2014年4月2日起停牌，本基金资产规模不断减小，本报告期末，本基金持有光正集团的市值超过基金资产净值的10%，除上述事项外，截至建仓期末和本报告期末，基金的资产配置符合基金契约的相关要求；

(3)截至本半年度报告披露日，本基金持有的光正集团流通股份已全部变现，基金的资产配置符合法律法规及基金合同的相关要求。

## §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

财通基金管理有限公司成立于2011年6月，由财通证券股份有限公司、杭州市实业投资集团有限公司和浙江升华拜克生物股份有限公司共同发起设立，财通证券股份有限公司为第一大股东，出资比例40%。公司注册资本2亿元人民币，注册地上海，经营范围为基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。

财通基金始终秉承“持有人利益至上”的核心价值观，致力于为客户提供专业优质的资产管理服务。在公募业务方面，公司坚持以客户利益为出发点设计产品，逐步建立起覆盖各种投资标的、各种风险收益特征的产品线，所发行的产品投资业绩良好，获得一定市场口碑；公司将特定客户资产管理业务（专户业务）作为未来发展的战略重点之一，形成玉泉系列（一对一）、富春系列（一对多）等多个子品牌，产品具有追求绝对收益、标的丰富、方案灵活等特点，为机构客户、高端个人客户提供个性化的理财选择。

公司现有员工90余人，管理人员和主要业务骨干的证券、基金从业平均年限在10年以上。通过提供多维度、人性化的客户服务，财通基金始终与持有人保持信息透明；通过建立完备的风险控制体系，财通基金最大限度地保证客户的利益。公司将以专业的投资能力、规范的公司治理、诚信至上的服务、力求创新的精神为广大投资者创造价值。

截至报告日，公司目前旗下有公募产品6只，分别为财通价值动量混合型证券投资基金、财通多策略稳健增长债券型证券投资基金、财通保本混合型发起式证券投资基金、中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数增强型证券投资基金以及财通可持续发展主题股票型证券投资基金、财通纯债分级债券型证券投资基金，正在运作的正在运作的正在运作的专户产品220余只。

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴松凯	本基金	2013年3月	2014年4月	6年	英国杜伦大学金融与投资

	的基金 经理、公 司基金 投资部 副总监	27日	14日		硕士，CFA，FRM。历任 工商银行深圳分行投资银 行部投行财务顾问、招商 银行总行计财部市场风险 计量与管理主管、华泰联 合证券研究所银行业首席 研究员。
赵媛媛	本基金 的基金 经理	2013年3月 27日	2014年4月 14日	7年	西南财经大学经济学硕 士。历任中宏保险投资部 权益投资经理，联合证券、 国泰君安证券宏观策略研 究员，国泰基金策略研究 员。2011年加入财通基金 管理有限公司，曾任研究 部高级宏观策略研究员。
赵艰申	本基金 的基金 经理、公 司基金 投资部 总监助 理	2013年8月 26日	—	7年	上海交通大学金融学硕 士。7年证券从业经验，曾 任中海基金研究发展部煤 炭电力、有色、钢铁、建 筑建材研究员、基金经理 助理、投资品小组组长， 2011年1月至2013年3月任 中海基金投资经理。2013 年3月加入财通基金管理 有限公司。

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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、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，没有损害基

金份额持有人利益的行为发生。

本基金通过认购非公开发行股票的方式，持有光正集团（股票代码“002524.SZ”）流通受限股份，限售期限为12个月，于2014年4月28日上市流通，现光正集团由于筹划重大资产重组及其他资产收购事项，自2014年4月2日起停牌，本基金资产规模不断减小，本报告期末，本基金持有光正集团的市值超过基金资产净值的10%，本基金管理人将在该股票可交易十日内将该比例调整至法律法规及基金合同规定的范围内。

截至本半年度报告披露日，本基金持有的光正集团流通股份已全部变现，基金的资产配置符合法律法规及基金合同的相关要求。

### 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

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开放式基金。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 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

2014年上半年，宏观经济下行压力加大，但是政府采取了一系列微刺激以及信贷货币的定向宽松政策。经济在二季度企稳，市场预期经济将在下半年保持平稳。

通过对行业及公司基本面的深入分析和合理的价值评估，我们报告期内主要超配了基本面良好，具备可持续发展潜力的公司股票。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年上半年，本基金净值增长率为16.72%，业绩比较基准增长率为-5.27%，跑赢业绩比较基准21.99%。自成立以来，本基金一直坚持价值投资，整体上取得较好的累计收益。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A股市场的持续低迷，主要源于经济预期的不明朗叠加市场制度的亟需完善。但中国经济长期增长动能充沛，而证券市场的改革也值得期待，加上当前许多蓝筹股估值的大幅折价，我们对于A股长期走势并不悲观。

展望2014年三季度，影响市场走势的主要因素在于宏观经济基本面以及IPO的进度。一方面，宏观经济虽然在二季度已经企稳，但持续性还需要观察；另一方面，经济改革的力度和速度目前来看还不明朗，市场需要观察新政府改革的具体动作，从而进一步展望未来经济；最后，由于IPO重启，新股发行节奏将会影响A股市场的小盘股的供给。

当前的市场风险与机遇并存。一方面，许多大盘蓝筹股PE处于7-12倍之间，估值处于历史底部，而基本面相对较为扎实，估值已经和国际接轨，部分行业估值低于H股同行业。与此同时，市场中有部分小盘股股票估值处于较高水平，而其盈利显然无法匹配其偏高的估值要求，在IPO重启的背景下，这类股票存在回归合理估值的可能。

对于投资标的选择，我们有两种投资思路：

一、将坚持可持续发展与合理估值的有机结合。一方面选择基本面良好，具备可持续发展潜力的公司；另一方面坚持以合理的价格买入，规避估值过度透支未来预期的公司。

二、在战略性新兴产业和国企改革领域，不少行业将受益于改革和政策红利，我们

将继续关注这些行业的主题性投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》等法律法规的有关规定，本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。

估值委员会成员由总经理、督察长、基金投资部、专户投资部、固定收益部、研究部、风险管理部、监察稽核部、基金清算部等部门负责人、基金清算部相关业务人员、涉及的相关基金经理或投资经理或实际履行前述部门相当职责的部门负责人或人员组成。估值委员会成员均具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司于2013年9月签订了《基金估值核算业务外包协议》，截至报告期末，基金管理人仅对旗下两只特定资产管理计划估值业务实行外包。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：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，最少1次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的25%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

根据相关法律法规及《基金合同》的要求，结合本基金运作情况，本报告期内本基金共分红1次，每份合计分红0.07元人民币。

## §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

本报告期内，本基金托管人在对财通可持续发展主题股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，财通可持续发展主题股票型证券投资基金的管理人——财通基金管理有限公司在财通可持续发展主题股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，财通可持续发展主题股票型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配，分配金额为1,810,413.05元。

## 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

本托管人依法对财通基金管理有限公司编制和披露的财通可持续发展主题股票型证券投资基金2014年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §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：财通可持续发展主题股票型证券投资基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,285,487.63	4,300,266.13
结算备付金		1,464,256.59	1,845,808.79
存出保证金		127,392.63	221,124.67
交易性金融资产	6.4.7.2	54,358,020.12	40,359,261.79
其中：股票投资		54,358,020.12	40,359,261.79
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—

买入返售金融资产	6.4.7.4	—	4,000,000.00
应收证券清算款		1,022,692.37	1,043,618.87
应收利息	6.4.7.5	1,839.07	1,854.14
应收股利		—	—
应收申购款		133,243.24	4,035.26
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		62,392,931.65	51,775,969.65
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014年6月30日</b>	<b>上年度末 2013年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		1,548,154.84	1,598,935.21
应付赎回款		160,045.68	140,628.91
应付管理人报酬		72,410.73	65,269.13
应付托管费		12,068.45	10,878.18
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	561,623.60	478,583.03
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	114,644.58	170,530.00
负债合计		2,468,947.88	2,464,824.46
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	46,684,484.51	42,428,433.39
未分配利润	6.4.7.10	13,239,499.26	6,882,711.80
所有者权益合计		59,923,983.77	49,311,145.19

负债和所有者权益总计		62,392,931.65	51,775,969.65
------------	--	---------------	---------------

注：(1)报告截止日2014年6月30日，基金份额净值1.284元，基金份额总额46,684,484.51份；

(2)后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

## 6.2 利润表

会计主体：财通可持续发展主题股票型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年3月27日-2013年6月30日
一、收入		8,133,448.01	3,007,385.41
1.利息收入		83,289.95	1,568,875.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	26,877.08	316,541.68
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		56,412.87	1,252,334.24
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,731,985.25	1,548,538.80
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,492,391.95	1,347,352.70
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	—	—
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7.14	—	—
股利收益	6.4.7.15	239,593.30	201,186.10
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	3,267,277.87	-196,406.26
4.汇兑收益（损失以“-”号填		—	—

列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	50,894.94	86,376.95
<b>减：二、费用</b>		1,622,804.83	1,802,107.23
1. 管理人报酬		336,500.69	1,153,039.08
2. 托管费		56,083.44	192,173.17
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7.18	1,115,580.41	405,197.36
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	6.4.7.19	114,640.29	51,697.62
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		6,510,643.18	1,205,278.18
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		6,510,643.18	1,205,278.18

注：(1)后附会计报表附注为本会计报表的组成部分；

(2)本基金于2013年3月27日成立，因此利润表上年度可比期间只列示从基金合同生效日至2013年6月30日数据，特此说明。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：财通可持续发展主题股票型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至2014年6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)	42,428,433.39	6,882,711.80	49,311,145.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	6,510,643.18	6,510,643.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	4,256,051.12	1,656,557.33	5,912,608.45

“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	38,485,737.49	10,098,820.13	48,584,557.62
2.基金赎回款（以“-”号填列)	-34,229,686.37	-8,442,262.80	-42,671,949.17
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)	—	-1,810,413.05	-1,810,413.05
五、期末所有者权益（基金净值)	46,684,484.51	13,239,499.26	59,923,983.77
项 目	上年度可比期间 2013年3月27日-2013年6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)	314,757,986.74	—	314,757,986.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	1,205,278.18	1,205,278.18
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)	-68,368,104.92	-158,379.96	-68,526,484.88
其中：1.基金申购款	569,779.33	4,984.82	574,764.15
2.基金赎回款（以“-”号填列)	-68,937,884.25	-163,364.78	-69,101,249.03
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)	246,389,881.82	1,046,898.22	247,436,780.04

注：（1）后附会计报表附注为本会计报表的组成部分；

（2）本基金于2013年3月27日成立，因此所有者权益变动表上年度可比期间只列示从基金合同生效日至2013年6月30日数据，特此说明。

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：

刘未

刘未

许志雄

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

财通可持续发展主题股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]1474号文《关于核准财通可持续发展主题股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人财通基金管理有限公司于2013年02月25日至2013年03月22日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）所验证并出具安永华明(2013)验字第60951782\_B25号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2013年03月27日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币314,691,268.38元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币66,718.36元，以上实收基金（本息）合计为人民币314,757,986.74元，折合314,757,986.74份基金份额。本基金的基金管理人为财通基金管理有限公司，注册登记机构为财通基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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、银行存款、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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（但需符合中国证监会的相关规定）。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：投资于股票资产的比例占基金资产的60%~95%；投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、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证券品种的比例占基金资产的5%—40%，其中，权证投资比例不高于基金资产净值的3%，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%。

本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×80% + 上证国债指数收益率×20%

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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2号《年度报告的内容与格式》、《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》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2014年6月30日的财务状况以及2014年1月1日至2014年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **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**

本基金本报告期无会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### **6.4.6 税项**

##### **1. 印花税**

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### **2. 营业税、企业所得税**

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券

投资基金) 管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[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》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定, 对证券投资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. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定, 对基金取得的股票的股息、红利收入, 债券的利息收入、储蓄存款利息收入, 由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施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》的规定, 自2013年1月1日起, 证券投资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; 持股期限超过1年的, 暂减按25%计入应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局财税字[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》的规定, 股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入, 暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定, 自2008年10月9日起, 对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
活期存款	5,285,487.63
定期存款	—
其中: 存款期限1-3个月	—
其他存款	—

合计	5,285,487.63
----	--------------

注：本基金本报告期末未投资于定期存款。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2014年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		48,068,134.79	54,358,020.12	6,289,885.33
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		48,068,134.79	54,358,020.12	6,289,885.33

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	1,194.49
应收定期存款利息	—

应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	593.01
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	51.57
合计	1,839.07

注：其他项目为交易所结算保证金的应收利息

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	561,623.60
银行间市场应付交易费用	—
合计	561,623.60

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	507.79
预提费用	114,136.79
合计	114,644.58

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,428,433.39	42,428,433.39
本期申购	38,485,737.49	38,485,737.49
本期赎回（以“-”号填列）	-34,229,686.37	-34,229,686.37
本期末	46,684,484.51	46,684,484.51

注：本期申购含红利再投、转换入份额，本期赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,062,605.31	-2,179,893.51	6,882,711.80
本期利润	3,243,365.31	3,267,277.87	6,510,643.18
本期基金份额交易产生的变动数	1,103,144.94	553,412.39	1,656,557.33
其中：基金申购款	9,060,477.45	1,038,342.68	10,098,820.13
基金赎回款	-7,957,332.51	-484,930.29	-8,442,262.80
本期已分配利润	-1,810,413.05	—	-1,810,413.05
本期末	11,598,702.51	1,640,796.75	13,239,499.26

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	17,747.24
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	7,635.89
其他	1,493.95
合计	26,877.08

注：其他项目包括结算保证金利息收入和应收申购款利息收入

#### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	386,644,297.22
减：卖出股票成本总额	382,151,905.27
买卖股票差价收入	4,492,391.95

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	—
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	—
减：应收利息总额	—
债券投资收益	—

注：本报告期内，本基金未投资债券，债券收益为零。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本报告期内，本基金未投资衍生工具，衍生工具收益为零。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	239,593.30
基金投资产生的股利收益	—
合计	239,593.30

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
1.交易性金融资产	3,267,277.87
——股票投资	3,267,277.87
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	3,267,277.87

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	50,826.84
转换费收入	68.10
合计	50,894.94

注：(1)本基金赎回费总额的25%归入基金资产；

(2)本基金的转换费由转出基金赎回费和转入基金申购补差费构成，其中赎回费部分的25%归入基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	1,115,580.41
银行间市场交易费用	—
合计	1,115,580.41

### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	14,795.19
信息披露费	89,341.60
帐户维护费	9,400.00
汇划手续费	203.50
其他费用	900.00
合计	114,640.29

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至2014年6月30日止，本基金未发生需要披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 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

本基金本报告期不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。

#### 6.4.9.2 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
财通基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
财通证券股份有限公司("财通证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
杭州市实业投资集团有限公司	基金管理人的股东
浙江升华拜克生物股份有限公司	基金管理人的股东
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构
上海财通资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年3月27日-2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
财通证券	122,738,522.95	15.75%	49,818,474.99	16.13%

注：本基金于2013年3月27日成立，因此上年度可比期间只列示从基金合同生效日至2013年6月30日数据，特此说明。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间2013年3月27日（基金合同生效日）-2013年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
财通证券	38,700,000.00	9.09%	—	—

注：本基金于2013年3月27日成立，因此上年度可比期间只列示从基金合同生效日至2013年6月30日数据，特此说明。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期

	2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券	109,751.63	17.22%	34,116.28	6.07%
关联方名称	上年度可比期间 2013年3月27日（基金合同生效日）-2013年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券	44,627.29	17.03%	44,627.29	17.03%

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、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示；

(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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年3月27日（基金合同生效日）-2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	336,500.69	1,153,039.08
其中：支付销售机构的客户维护费	208,015.75	834,346.45

注：(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起2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、休息日，支付日期顺延；

(2)基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数；

(3)客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目；

(4)本基金于2013年3月27日成立，因此上年度可比期间只列示从基金合同生效日至2013年6月30日数据，特此说明。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年3月27日(基金合同生效日)-2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
当期发生的基金应支付的托管费		56,083.44		192,173.17

注：(1)支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延；  
(2)基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数；  
(3)本基金于2013年3月27日成立，因此上年度可比期间只列示从基金合同生效日至2013年6月30日数据，特此说明。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

本报告期末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年3月27日(基金合同生效日)-2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行活期存款	5,285,487.63	17,747.24	141,806,224.29	306,156.54

注：(1)本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息；  
(2)本基金于2013年3月27日成立，因此上年度可比期间只列示从基金合同生效日至2013年6月30日数据，特此说明。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项的说明。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形 式 发放总 额	再投资形式 发放总额	利润分 配 合计	备注
1	2014-03- 25	2014-3-25	0.700	1,004,00 5.34	806,407.71	1,810,41 3.05	-
合计			0.700	1,004,00 5.34	806,407.71	1,810,41 3.05	-

#### 6.4.12 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌原因	期末 估值单价	复牌 日期	复牌 开盘单价	数量	期末 成本总额	期末 估值总额
00252 4	光正 集团	2014- 04-02	其他资产 收购	6.36	2014- 08-13	7.00	2,280, 000	9,000,000. 00	14,500,800 .00

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的管理人进行风险管理的主要目标是加强对投资风险防范和控制，保证基金资产的安全，维护基金份额持有人的利益；同时，提升基金投资组合的风险调整后收益水平，将以上各种风险控制在限定的范围之内，在基金的风险和收益之间取得最佳的平衡，实现“风险和收益相匹配”的投资目标，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会下设合规控制委员会，负责对公司风险管理战略和政策、内部控制及风险控制基本制度进行审定，对基本制度的执行情况、关联交易的合法合规性等进行监督和检查。董事会聘任督察长，负责公司及其基金运作的监察稽核工作。总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作，公司下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。公司各业务部门根据具体情况制定本部门的作业流程及风险控制制度，加强对风险的控制，作为一线责任人，将风险控制在最小范围内。同时，公司设独立的监察稽核部和风险管理部，两者各自职能对公司运作各环节的各类风险进行监控。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对各类投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，按银行同业利率计息，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%（本基金通过认购非公开发行股票的方式，持有光正集团（股票代码“002524.SZ”）流通受限股份，限售期限为12个月，于2014年4月28日上市流通，现光正集团由于筹划重大资产重组及其他资产收购事项，自2014年4月2日起停牌，本基金资产规模不断减小，本报告期末，本基金持有光正集团的市值超过基金资产净值的10%，本基金管理人将在该股票可交易十日内将该比例调整至法律法规及基金合同规定的范围内。），且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款，结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末	1个月以	1-3个月	3个月	1-5年	5年以上	不计息	合计
-----	------	-------	-----	------	------	-----	----

2014年6月 30日	内		-1年				
资产							
银行存款	5,285,48 7.63	—	—	—	—	—	5,285,48 7.63
结算备付金	1,464,25 6.59	—	—	—	—	—	1,464,25 6.59
存出保证金	127,392. 63	—	—	—	—	—	127,392. 63
交易性金融 资产	—	—	—	—	—	54,358,0 20.12	54,358,0 20.12
应收证券清 算款	—	—	—	—	—	1,022,69 2.37	1,022,69 2.37
应收利息	—	—	—	—	—	1,839.07	1,839.07
应收申购款	—	—	—	—	—	133,243. 24	133,243. 24
资产总计	6,877,13 6.85	—	—	—	—	55,515,7 94.80	62,392,9 31.65
负债							
应付证券清 算款	—	—	—	—	—	1,548,15 4.84	1,548,15 4.84
应付赎回款	—	—	—	—	—	160,045. 68	160,045. 68
应付管理人 报酬	—	—	—	—	—	72,410.7 3	72,410.7 3
应付托管费	—	—	—	—	—	12,068.4 5	12,068.4 5
应付交易费 用	—	—	—	—	—	561,623. 60	561,623. 60
其他负债	—	—	—	—	—	114,644. 58	114,644. 58
负债总计	—	—	—	—	—	2,468,94 7.88	2,468,94 7.88
利率敏感度	6,877,13 6.85	—	—	—	—	53,046,8 46.92	59,923,9 83.77

缺口							
上年度末 2013年12月 31日	1个月以 内	1-3个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,300,26 6.13	—	—	—	—	—	4,300,26 6.13
结算备付金	1,845,80 8.79	—	—	—	—	—	1,845,80 8.79
存出保证金	221,124. 67	—	—	—	—	—	221,124. 67
交易性金融 资产	—	—	—	—	—	40,359,2 61.79	40,359,2 61.79
买入返售金 融资产	4,000,00 0.00	—	—	—	—	—	4,000,00 0.00
应收证券清 算款	—	—	—	—	—	1,043,61 8.87	1,043,61 8.87
应收利息	—	—	—	—	—	1,854.14	1,854.14
应收申购款	—	—	—	—	—	4,035.26	4,035.26
资产总计	10,367,1 99.59	—	—	—	—	41,408,7 70.06	51,775,9 69.65
负债							
应付证券清 算款	—	—	—	—	—	1,598,93 5.21	1,598,93 5.21
应付赎回款	—	—	—	—	—	140,628. 91	140,628. 91
应付管理人 报酬	—	—	—	—	—	65,269.1 3	65,269.1 3
应付托管费	—	—	—	—	—	10,878.1 8	10,878.1 8
应付交易费 用	—	—	—	—	—	478,583. 03	478,583. 03
其他负债	—	—	—	—	—	170,530. 00	170,530. 00

负债总计	—	—	—	—	—	2,464,824.46	2,464,824.46
利率敏感度缺口	10,367,199.59	—	—	—	—	38,943,945.60	49,311,145.19

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

截至报告期末，本基金无交易性债券投资，因此利率风险因素对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于证券市场的整体波动，以及单个证券发行主体的自身经营情况或特殊事件影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以价值投资为核心，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，投资于股票资产的比例占基金资产的60%~95%；投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、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证券品种的比例占基金资产的5%—40%，其中，权证投资比例不高于基金资产净值的3%，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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	54,358,020.12	90.71	40,359,261.79	81.85
交易性金融资产-基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产-债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产-贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	54,358,020.12	90.71	40,359,261.79	81.85

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.基金的市场价格风险决定于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及业绩比较基准的变动。		
假设	2.除业绩比较基准变动外，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
假设	3.贝塔系数的估计以过去一年的历史数据作为样本，采用线性回归法估计。		
假设	4.业绩比较基准的变动对基金的净值表现具有对称性影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
	业绩比较基准增加1%	459,488.06	369,243.34
	业绩比较基准减少1%	-459,488.06	-369,243.34

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至报告期末，本基金无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（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	54,358,020.12	87.12
	其中：股票	54,358,020.12	87.12
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	6,749,744.22	10.82
7	其他资产	1,285,167.31	2.06
8	合计	62,392,931.65	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,427,264.05	2.38
B	采矿业	—	—
C	制造业	28,047,243.87	46.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	14,500,800.00	24.20
F	批发和零售业	1,135,000.00	1.89
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,757,390.00	9.61
J	金融业	1,644,376.48	2.74
K	房地产业	1,595,195.80	2.66

L	租赁和商务服务业	250,749.92	0.42
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	54,358,020.12	90.71

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002524	光正集团	2,280,000	14,500,800.00	24.20
2	001696	宗申动力	700,000	3,171,000.00	5.29
3	300121	阳谷华泰	338,900	3,060,267.00	5.11
4	600571	信雅达	150,000	2,923,500.00	4.88
5	601233	桐昆股份	464,400	2,846,772.00	4.75
6	300339	润和软件	154,700	2,815,540.00	4.70
7	300252	金信诺	91,950	2,512,993.50	4.19
8	002184	海得控制	199,934	2,319,234.40	3.87
9	600716	凤凰股份	195,970	1,595,195.80	2.66
10	002714	牧原股份	32,401	1,427,264.05	2.38
11	600019	宝钢股份	300,000	1,230,000.00	2.05
12	600884	杉杉股份	69,968	1,202,749.92	2.01
13	600535	天士力	30,000	1,163,100.00	1.94
14	300371	汇中股份	45,000	1,155,150.00	1.93
15	600511	国药股份	50,000	1,135,000.00	1.89
16	300073	当升科技	60,000	1,128,000.00	1.88
17	300037	新宙邦	30,000	1,089,000.00	1.82

18	002481	双塔食品	79,902	1,070,686.80	1.79
19	002684	猛狮科技	49,951	1,057,462.67	1.76
20	002179	中航光电	60,000	1,053,000.00	1.76
21	002191	劲嘉股份	69,932	930,095.60	1.55
22	000001	平安银行	90,000	891,900.00	1.49
23	300308	中际装备	60,000	863,400.00	1.44
24	600835	上海机电	50,000	779,000.00	1.30
25	601998	中信银行	176,224	752,476.48	1.26
26	600521	华海药业	55,000	607,750.00	1.01
27	300207	欣旺达	19,932	582,014.40	0.97
28	300058	蓝色光标	9,448	250,749.92	0.42
29	002568	百润股份	9,891	178,038.00	0.30
30	002290	禾盛新材	3,598	47,529.58	0.08
31	300168	万达信息	1,000	18,350.00	0.03

注：(1)本基金通过认购非公开发行股票的方式，持有光正集团（股票代码“002524.SZ”）流通受限股份，限售期限为12个月，于2014年4月28日上市流通，现光正集团由于筹划重大资产重组及其他资产收购事项，自2014年4月2日起停牌，本基金资产规模不断减小，本报告期末，本基金持有光正集团的市值超过基金资产净值的10%，本基金管理人将在该股票可交易十日内将该比例调整至法律法规及基金合同规定的范围内；

(2) 截至本半年度报告披露日，本基金持有的光正集团流通股份已全部变现，基金的资产配置符合法律法规及基金合同的相关要求。

## 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初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例(%)
1	001696	宗申动力	9,642,983.28	19.56
2	601166	兴业银行	7,712,467.06	15.64
3	300005	探路者	7,476,687.63	15.16
4	300184	力源信息	6,230,645.59	12.64
5	600716	凤凰股份	5,973,717.01	12.11
6	000651	格力电器	5,799,292.54	11.76

7	600312	平高电气	5,773,159.73	11.71
8	002005	德豪润达	5,760,666.65	11.68
9	002539	新都化工	5,646,782.74	11.45
10	600261	阳光照明	5,512,084.52	11.18
11	002236	大华股份	5,418,476.11	10.99
12	002184	海得控制	5,298,051.92	10.74
13	600323	瀚蓝环境	4,900,669.41	9.94
14	600703	三安光电	4,818,399.91	9.77
15	300133	华策影视	4,524,579.10	9.18
16	300219	鸿利光电	3,801,066.50	7.71
17	600571	信雅达	3,793,580.10	7.69
18	300058	蓝色光标	3,693,111.50	7.49
19	601288	农业银行	3,665,000.00	7.43
20	002415	海康威视	3,569,667.08	7.24
21	000793	华闻传媒	3,537,436.24	7.17
22	000988	华工科技	3,508,613.80	7.12
23	002191	劲嘉股份	3,433,174.28	6.96
24	002091	江苏国泰	3,349,978.49	6.79
25	600770	综艺股份	3,251,730.81	6.59
26	600880	博瑞传播	3,208,100.00	6.51
27	000001	平安银行	3,154,700.00	6.40
28	300104	乐视网	3,153,346.10	6.39
29	600633	浙报传媒	3,091,185.38	6.27
30	002400	省广股份	3,077,858.89	6.24
31	002562	兄弟科技	2,988,782.00	6.06
32	600063	皖维高新	2,970,900.00	6.02
33	300339	润和软件	2,958,781.89	6.00
34	601233	桐昆股份	2,939,750.00	5.96
35	300121	阳谷华泰	2,841,579.38	5.76
36	002303	美盈森	2,807,741.78	5.69
37	300248	新开普	2,790,990.32	5.66

38	601218	吉鑫科技	2,786,188.00	5.65
39	000625	长安汽车	2,754,865.70	5.59
40	300037	新宙邦	2,745,208.27	5.57
41	600884	杉杉股份	2,713,721.83	5.50
42	002699	美盛文化	2,582,605.41	5.24
43	300094	国联水产	2,574,938.63	5.22
44	002489	浙江永强	2,566,316.54	5.20
45	002344	海宁皮城	2,543,257.50	5.16
46	002241	歌尔声学	2,542,318.20	5.16
47	300252	金信诺	2,509,704.87	5.09
48	600016	民生银行	2,496,420.00	5.06
49	300232	洲明科技	2,461,168.06	4.99
50	600837	海通证券	2,401,173.00	4.87
51	300043	互动娱乐	2,399,304.50	4.87
52	300157	恒泰艾普	2,253,044.04	4.57
53	600109	国金证券	2,229,059.00	4.52
54	002584	西陇化工	2,217,854.45	4.50
55	601857	中国石油	2,202,451.00	4.47
56	600651	飞乐音响	2,201,385.44	4.46
57	600667	太极实业	2,197,428.00	4.46
58	002296	辉煌科技	2,153,827.65	4.37
59	600079	人福医药	2,148,643.23	4.36
60	002286	保龄宝	2,112,908.00	4.28
61	002174	游族网络	2,064,876.86	4.19
62	300207	欣旺达	2,021,862.76	4.10
63	600978	宜华木业	1,990,939.20	4.04
64	300027	华谊兄弟	1,951,806.01	3.96
65	600108	亚盛集团	1,945,354.38	3.95
66	601808	中海油服	1,927,375.96	3.91
67	002440	闰土股份	1,921,454.28	3.90
68	002280	新世纪	1,912,746.48	3.88

69	600835	上海机电	1,896,285.16	3.85
70	002535	林州重机	1,882,338.26	3.82
71	300137	先河环保	1,864,490.77	3.78
72	600267	海正药业	1,846,680.42	3.75
73	600060	海信电器	1,841,208.90	3.73
74	600525	长园集团	1,838,236.50	3.73
75	000729	燕京啤酒	1,795,750.00	3.64
76	600794	保税科技	1,791,034.00	3.63
77	002390	信邦制药	1,785,645.00	3.62
78	300170	汉得信息	1,774,584.00	3.60
79	002024	苏宁云商	1,707,441.41	3.46
80	002255	海陆重工	1,695,929.20	3.44
81	300129	泰胜风能	1,694,332.15	3.44
82	300113	顺网科技	1,662,217.78	3.37
83	300128	锦富新材	1,661,457.38	3.37
84	600832	东方明珠	1,658,687.00	3.36
85	600266	北京城建	1,657,103.71	3.36
86	000538	云南白药	1,651,928.07	3.35
87	600597	光明乳业	1,640,457.83	3.33
88	300059	东方财富	1,629,763.34	3.31
89	002594	比亚迪	1,593,525.27	3.23
90	600549	厦门钨业	1,586,722.92	3.22
91	600887	伊利股份	1,576,359.01	3.20
92	300079	数码视讯	1,538,259.00	3.12
93	000002	万 科 A	1,530,000.00	3.10
94	000939	凯迪电力	1,515,086.94	3.07
95	600089	特变电工	1,472,636.10	2.99
96	600000	浦发银行	1,461,716.05	2.96
97	300196	长海股份	1,442,995.40	2.93
98	002714	牧原股份	1,394,879.40	2.83
99	002104	恒宝股份	1,373,722.43	2.79

100	002482	广田股份	1,361,798.24	2.76
101	000400	许继电气	1,343,333.00	2.72
102	600352	浙江龙盛	1,329,485.19	2.70
103	002131	利欧股份	1,322,492.90	2.68
104	600616	金枫酒业	1,275,241.59	2.59
105	002138	顺络电子	1,233,935.00	2.50
106	600363	联创光电	1,226,311.89	2.49
107	600019	宝钢股份	1,209,000.00	2.45
108	300371	汇中股份	1,195,362.28	2.42
109	600406	国电南瑞	1,175,290.00	2.38
110	300369	绿盟科技	1,167,551.00	2.37
111	600535	天士力	1,160,924.00	2.35
112	300205	天喻信息	1,151,412.50	2.34
113	300183	东软载波	1,149,438.87	2.33
114	002638	勤上光电	1,129,309.80	2.29
115	002444	巨星科技	1,127,053.58	2.29
116	002565	上海绿新	1,116,500.00	2.26
117	000997	新大陆	1,104,498.00	2.24
118	600993	马应龙	1,098,880.00	2.23
119	300287	飞利信	1,091,762.22	2.21
120	000541	佛山照明	1,088,367.44	2.21
121	002179	中航光电	1,079,992.00	2.19
122	002481	双塔食品	1,076,076.19	2.18
123	600767	运盛实业	1,071,830.00	2.17
124	002684	猛狮科技	1,071,062.22	2.17
125	000063	中兴通讯	1,068,206.24	2.17
126	600511	国药股份	1,059,443.12	2.15
127	002375	亚厦股份	1,057,143.72	2.14
128	600645	中源协和	1,054,964.00	2.14
129	000516	开元投资	1,054,030.00	2.14
130	600967	北方创业	1,036,135.80	2.10

131	002334	英威腾	1,034,159.01	2.10
132	300221	银禧科技	1,017,567.00	2.06
133	300073	当升科技	1,014,594.00	2.06
134	002664	信质电机	1,011,626.10	2.05
135	002080	中材科技	1,001,563.94	2.03
136	300136	信维通信	999,417.82	2.03
137	300064	豫金刚石	990,148.00	2.01

注：“买入金额”按买入成交金额（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初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例(%)
1	300005	探路者	7,841,840.55	15.90
2	601166	兴业银行	7,831,050.00	15.88
3	001696	宗申动力	6,556,620.12	13.30
4	300184	力源信息	5,874,690.84	11.91
5	000651	格力电器	5,748,044.30	11.66
6	002539	新都化工	5,717,702.03	11.60
7	002005	德豪润达	5,692,968.80	11.54
8	600312	平高电气	5,530,989.49	11.22
9	600261	阳光照明	5,480,807.83	11.11
10	002236	大华股份	5,336,666.45	10.82
11	600323	瀚蓝环境	5,214,156.39	10.57
12	600703	三安光电	4,916,806.74	9.97
13	300133	华策影视	4,605,946.00	9.34
14	300219	鸿利光电	4,274,914.11	8.67
15	600716	凤凰股份	4,135,999.74	8.39
16	000988	华工科技	3,720,068.00	7.54
17	601288	农业银行	3,710,940.10	7.53
18	002415	海康威视	3,626,079.84	7.35

19	300058	蓝色光标	3,453,553.84	7.00
20	600770	综艺股份	3,435,199.50	6.97
21	000793	华闻传媒	3,373,459.56	6.84
22	002091	江苏国泰	3,352,955.34	6.80
23	002022	科华生物	3,275,782.75	6.64
24	002562	兄弟科技	3,217,039.11	6.52
25	600880	博瑞传播	3,183,481.55	6.46
26	002400	省广股份	3,164,313.53	6.42
27	600063	皖维高新	3,130,800.00	6.35
28	600633	浙报传媒	3,125,028.60	6.34
29	002303	美盈森	3,088,471.00	6.26
30	300248	新开普	3,024,220.00	6.13
31	300104	乐视网	2,954,391.30	5.99
32	002184	海得控制	2,932,684.52	5.95
33	300137	先河环保	2,875,357.22	5.83
34	000625	长安汽车	2,805,592.00	5.69
35	300094	国联水产	2,762,560.64	5.60
36	002699	美盛文化	2,728,197.02	5.53
37	601218	吉鑫科技	2,704,603.15	5.48
38	000620	新华联	2,644,500.00	5.36
39	002191	劲嘉股份	2,622,716.00	5.32
40	002489	浙江永强	2,594,977.84	5.26
41	002241	歌尔声学	2,573,043.95	5.22
42	600016	民生银行	2,514,240.00	5.10
43	300043	互动娱乐	2,511,833.70	5.09
44	000939	凯迪电力	2,490,450.35	5.05
45	002344	海宁皮城	2,479,255.69	5.03
46	600837	海通证券	2,384,200.00	4.84
47	002584	西陇化工	2,379,163.44	4.82
48	300232	洲明科技	2,370,692.52	4.81
49	600651	飞乐音响	2,315,036.00	4.69

50	600667	太极实业	2,311,785.89	4.69
51	000001	平安银行	2,266,180.28	4.60
52	002482	广田股份	2,230,678.20	4.52
53	002535	林州重机	2,226,606.30	4.52
54	601857	中国石油	2,218,500.00	4.50
55	002081	金螳螂	2,136,717.12	4.33
56	002174	游族网络	2,128,947.70	4.32
57	002550	千红制药	2,112,780.99	4.28
58	600109	国金证券	2,085,427.35	4.23
59	600525	长园集团	2,079,465.00	4.22
60	600079	人福医药	2,075,814.22	4.21
61	002286	保龄宝	2,072,046.00	4.20
62	002296	辉煌科技	2,024,148.80	4.10
63	300027	华谊兄弟	2,017,217.00	4.09
64	300157	恒泰艾普	2,009,299.58	4.07
65	600978	宜华木业	1,991,567.19	4.04
66	002440	闰土股份	1,986,984.49	4.03
67	600266	北京城建	1,976,910.30	4.01
68	601808	中海油服	1,949,911.98	3.95
69	002280	新世纪	1,860,251.06	3.77
70	300170	汉得信息	1,834,912.00	3.72
71	002390	信邦制药	1,833,802.00	3.72
72	600267	海正药业	1,810,815.30	3.67
73	600060	海信电器	1,808,583.10	3.67
74	600794	保税科技	1,807,162.94	3.66
75	002255	海陆重工	1,773,081.47	3.60
76	600108	亚盛集团	1,771,600.00	3.59
77	000729	燕京啤酒	1,768,000.00	3.59
78	002024	苏宁云商	1,744,450.00	3.54
79	600832	东方明珠	1,738,469.00	3.53
80	300037	新宙邦	1,735,502.80	3.52

81	300128	锦富新材	1,703,229.90	3.45
82	300129	泰胜风能	1,692,854.00	3.43
83	600597	光明乳业	1,675,822.05	3.40
84	002131	利欧股份	1,657,225.60	3.36
85	300059	东方财富	1,622,560.00	3.29
86	600884	杉杉股份	1,612,763.63	3.27
87	300113	顺网科技	1,598,755.08	3.24
88	600887	伊利股份	1,582,287.62	3.21
89	000538	云南白药	1,579,584.40	3.20
90	002630	华西能源	1,568,695.53	3.18
91	600549	厦门钨业	1,563,795.96	3.17
92	002594	比亚迪	1,529,661.56	3.10
93	000002	万 科 A	1,526,800.00	3.10
94	300079	数码视讯	1,517,059.44	3.08
95	300207	欣旺达	1,514,929.97	3.07
96	600089	特变电工	1,461,999.78	2.96
97	300196	长海股份	1,449,709.82	2.94
98	600000	浦发银行	1,414,953.45	2.87
99	002663	普邦园林	1,389,022.47	2.82
100	000400	许继电气	1,372,700.00	2.78
101	002104	恒宝股份	1,345,505.83	2.73
102	600352	浙江龙盛	1,320,400.00	2.68
103	002349	精华制药	1,318,231.25	2.67
104	600571	信雅达	1,280,462.80	2.60
105	002138	顺络电子	1,278,900.00	2.59
106	300369	绿盟科技	1,274,919.60	2.59
107	600475	华光股份	1,269,942.69	2.58
108	600363	联创光电	1,202,274.51	2.44
109	600406	国电南瑞	1,196,667.27	2.43
110	600616	金枫酒业	1,188,947.11	2.41
111	300221	银禧科技	1,167,640.00	2.37

112	002638	勤上光电	1,146,062.00	2.32
113	000541	佛山照明	1,145,000.00	2.32
114	300183	东软载波	1,137,540.71	2.31
115	300287	飞利信	1,130,209.50	2.29
116	600767	运盛实业	1,127,100.00	2.29
117	300205	天喻信息	1,126,651.00	2.28
118	002080	中材科技	1,116,559.12	2.26
119	002334	英威腾	1,115,391.19	2.26
120	002565	上海绿新	1,107,400.00	2.25
121	002444	巨星科技	1,103,619.92	2.24
122	600446	金证股份	1,099,422.50	2.23
123	000516	开元投资	1,095,003.00	2.22
124	600993	马应龙	1,091,833.00	2.21
125	000063	中兴通讯	1,084,873.92	2.20
126	000716	南方食品	1,083,738.00	2.20
127	600645	中源协和	1,075,620.00	2.18
128	002375	亚厦股份	1,072,418.13	2.17
129	002664	信质电机	1,066,884.00	2.16
130	600835	上海机电	1,063,409.00	2.16
131	000997	新大陆	1,062,362.00	2.15
132	600104	上汽集团	1,047,000.00	2.12
133	300064	豫金刚石	1,044,306.01	2.12
134	002512	达华智能	1,039,424.40	2.11
135	002597	金禾实业	1,038,400.00	2.11
136	600967	北方创业	1,032,574.50	2.09
137	300136	信维通信	998,533.02	2.02

注：“卖出金额”按卖出成交金额（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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	392,883,385.73
---------------	----------------

卖出股票的收入（成交）总额	386,644,297.22
---------------	----------------

注：本表"买入股票成本（成交）总额"，"卖出股票收入（成交）总额"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。

## 7.5 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。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率，更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中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。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1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。

7.12.2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。

### 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	127,392.63
2	应收证券清算款	1,022,692.37
3	应收股利	—
4	应收利息	1,839.07
5	应收申购款	133,243.24
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,285,167.31

### 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

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	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002524	光正集团	14,500,800.00	24.20	其他资产收购

### 7.12.6 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。

## §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
1,881	24,818.97	—	—	46,684,484.51	100%

### 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	89.68	—

注：（1）本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0；  
（2）本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	-	0
	-	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	-	0
	-	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013年3月27日)基金份额总额	314,757,986.74
---------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	42,428,433.39
本报告期基金总申购份额	38,485,737.49
减：本报告期基金总赎回份额	34,229,686.37
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	46,684,484.51

注：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。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

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、财通纯债分级债券型证券投资基金基金合同于2014年1月17日正式生效，邵骏先生任该基金的基金经理；

2、财通可持续发展主题股票型证券投资基金原基金经理吴松凯先生、赵媛媛女士于2014年4月14日离任，该基金由赵艰申先生继续管理；

3、财通价值量混合型证券投资基金原基金经理吴松凯先生于2014年6月10日离任，本基金由赵艰申先生接替管理；

4、本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

### 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本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

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

## 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

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

## 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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	2	122,738,522.95	15.75%	109,751.63	17.22%	—
东方证券	2	69,320,445.29	8.89%	48,381.63	7.59%	—
国泰君安	2	86,774,025.80	11.13%	60,156.64	9.44%	—
海通证券	2	140,603,750.87	18.04%	97,516.96	15.30%	—
申银万国	2	83,418,630.38	10.70%	74,182.97	11.64%	—
招商证券	2	54,870,749.24	7.04%	49,277.73	7.73%	—
中金公司	2	50,252,130.08	6.45%	44,881.50	7.04%	—
中信证券	2	171,497,754.24	22.00%	153,109.89	24.03%	—

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全的证券经营机构；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1)投资、研究部门与券商联系商讨合作意向，根据公司对券商交易单元的选择标准，确定选用交易单元的所属券商以及（主）交易单元，报投资总监与总经理审核批准；
- (2)集中交易部与券商商议交易单元租用协议，经相关业务部门确认后，报公司领导审批；
- (3)基金清算部负责对接托管行、各证券交易所、中登公司上海和深圳分公司办理交易单元手续及账

户开户手续。

### 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	
	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
财通证券	—	—	38,700,000.00	9.09%	—	—
东方证券	—	—	62,500,000.00	14.68%	—	—
国泰君安	—	—	35,100,000.00	8.24%	—	—
海通证券	—	—	106,300,000.00	24.96%	—	—
申银万国	—	—	25,800,000.00	6.06%	—	—
招商证券	—	—	10,000,000.00	2.35%	—	—
中金公司	—	—	61,300,000.00	14.40%	—	—
中信证券	—	—	86,100,000.00	20.22%	—	—

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《财通基金管理有限公司关于旗下基金2013年年度资产净值的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2014-01-02
2	《山东龙泉管道工程股份有限公司简式权益变动报告书》	中国证监会指定报刊及网站	2014-01-09
3	《财通可持续发展主题股票型证券投资基金2013年第4季度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2014-01-22
4	《财通基金管理有限公司关于高级管理人员在子公司兼任职务及	中国证监会指定报刊及网站	2014-03-12

	领薪情况的公告》		
5	《财通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加光大证券手机客户端申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2014-03-18
6	《财通可持续发展主题股票型证券投资基金分红公告》	中国证监会指定报刊及网站	2014-03-20
7	《财通可持续发展主题股票型证券投资基金2013年年度报告》及其摘要	中国证监会指定报刊及网站	2014-03-29
8	《财通可持续发展主题股票型证券投资基金基金经理变更公告》	中国证监会指定报刊及网站	2014-04-15
9	《杭州天目山药业股份有限公司简式权益变动报告书》	中国证监会指定报刊及网站	2014-04-16
10	《财通可持续发展主题股票型证券投资基金2014年第1季度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2014-04-21
11	《杭州天目山药业股份有限公司简式权益变动报告书（更新后）》	中国证监会指定报刊及网站	2014-04-24
12	《财通可持续发展主题股票型证券投资基金更新招募说明书（2014年第1号）》及其摘要	中国证监会指定报刊及网站	2014-05-09
13	《上海现代制药股份有限公司简式权益变动报告书》	中国证监会指定报刊及网站	2014-05-13
14	《财通基金管理有限公司关于北京分公司设立的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2014-06-03
15	《财通可持续发展主题股票型证券投资基金2014年年中资产净值的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2014-07-01

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件；

- 2、财通可持续发展主题股票型证券投资基金基金合同；
- 3、财通可持续发展主题股票型证券投资基金基金托管协议；
- 4、财通可持续发展主题股票型证券投资基金招募说明书；
- 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。

## 11.2 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。

## 11.3 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

二〇一四年八月二十八日