

财通可持续发展主题混合型证券投资基金2016年半年度报告摘要

2016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：2016年8月26日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月19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。本报告中财务资料未经审计。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	财通可持续混合
场内简称	-
基金主代码	000017
交易代码	-
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	80,664,824.39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混合基金，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	021-20537888
	电子邮箱	service@ctfund.com
客户服务电话	400-820-9888	95588
传真	021-20537999	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ctfund.com
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

§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（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-18,473,481.43
本期利润	-34,114,618.62
加权平均基金份额本期利润	-0.4184
本期基金份额净值增长率	-16.18%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.6457
期末基金资产净值	139,181,986.08
期末基金份额净值	1.725

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（为期末余额，不是当期发生数）。

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	6.35%	1.56%	-0.32%	0.78%	6.67%	0.78%
过去三个月	6.09%	1.38%	-1.42%	0.81%	7.51%	0.57%
过去六个月	-16.18%	2.10%	-11.93%	1.47%	-4.25%	0.63%
过去一年	-24.83%	2.27%	-22.77%	1.84%	-2.06%	0.43%
过去三年	127.86%	1.88%	39.74%	1.47%	88.12%	0.41%
自基金合同生效日起至今（2013年03月27日-2016年06月30日）	128.78%	1.81%	23.58%	1.45%	105.20%	0.36%

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

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-2016年6月30日)



注：(1)本基金合同生效日为2013年3月27日；

(2)根据《基金合同》规定：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： $\leq 3\%$ ，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值： $\geq 5\%$ 。本基金的建仓期为2013年3月27日至2013年9月27日，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) 根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，并经与基金托管人协商一致，本基金类型自2015年1月5日起由股票型变更为混合型，其基金名称变更为“财通可持续发展主题混合型证券投资基金”，对应基金简称变更为“财通可持续混合”。具体信息详见基金管理人发布的相关公告。

§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，获得一定市场口碑；公司将特定客户资产管理业务作为重要发展战略之一，形成玉泉系列、富春系列、永安系列等多个子品

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150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。

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		
金梓才	本基金的基金经理、公司基金投资部副总监	2015年7月13日	—	6年	上海交通大学工学硕士。历任华泰资产管理有限公司投资经理助理，信诚基金管理有限公司TMT行业高级研究员。2014年8月加入财通基金管理有限公司。
夏钦	本基金的基金经理	2016年5月11日	—	8年	上海交通大学会计学硕士。历任上海申银万国证券研究所高级研究员、UBS(瑞银)董事、平安资产管理有限责任公司策略研究经理，2015年9月加入财通基金管理有限公司，现任基金投资部基金经理。

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》、《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》、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 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。

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

2016年上半年市场出现了较大波动。一季度，在人民币大幅贬值以及熔断机制等因素影响下，开年第一天市场就以暴跌熔断开场，并且整个一月份都处于恐慌情绪中。3月后市场开始逐渐企稳反弹，并且主题投资、次新股等开始活跃，虽然此后经历了英国脱欧以及MSCI预期落空的影响，但市场仍然保持相对强势，基本说明了市场暂时脱离了恐慌的氛围。在此过程中，我们精选了高成长性，竞争优势明显的成长股，并且适度参与了部分主题投资，使得二季度净值有所回升，相信未来市场在经历了多种利空考验之后，运行会更加平稳理性，专业研究的价值也将会逐渐体现。

通过对行业及公司基本面的深入分析和合理的价值评估，我们在报告期内仍然更加偏好成长股投资，积极配置新兴产业中的龙头公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016年上半年度，本基金净值增长率为-16.18%，业绩比较基准增长率为-11.93%，跑输业绩比较基准4.25%。本基金一贯坚持价值投资的风格，整体上取得了一定的累计收益。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年下半年，我们预计经济将继续保持企稳甚至小幅回升的态势，这主要依赖于上半年对于基建投资的拉动以及地产销售的回升。在经济相对平稳的情况下，流动性整体虽然保持相对充裕，但是由于大规模刺激难现，因此传统产业需要从供给端以及成本端出发，寻找阶段性的投资机会，但整体来说难以出现持续性的行情；

从海外市场来看，未来海外市场的波动是下半年中国最大的扰动因素。一方面，英国脱欧之后，虽然海外市场下跌之后很快拉回，似乎显示投资者对于脱欧后的影响短期已经反应结束，但事实上未来还面临很多不确定性，并且脱欧之后对英国自身经济的影响以及对欧盟竞争力的影响等都还无法下结论，因此还不能完全认为是已经靴子落地；另一方面，美国加息的节奏可能因为英国脱欧而推后，但是美联储也表态未来主要还是看美国自身的经济以及就业情况，因此对市场的影响也始终是未落地的靴子；此外，由于海外因素而导致的人民币贬值压力近期又开始出现，未来的演变以及市场的反应也值得我们关注。但正是由于全球央行被动放水以及经济的相对疲弱可能使得保值需求上升，一些贵金属值得重点关注。

整体来看，我们认为在历经几次大跌之后，A股市场恐慌情绪已大幅释放，未来市场逐渐进入正常期。虽然未来市场估值泡沫去化的过程可能从中长期来看仍然继续，但新兴产业的崛起也将带来结构性机会，我们重点关注未来行业有望高速增长、有政策支撑的战略新兴行业以及自身景气快速回升的细分行业，我们将在这些行业中寻找具有竞争力的公司，并且结合市场不同阶段的不同风险偏好进行操作。

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，基金管理人未对旗下公开募集证券投资基金及特定客户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0.1708元人民币。

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 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混合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混合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混合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混合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13,659,381.16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混合型证券投资基金2016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混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款		19,231,528.44	12,995,289.34
结算备付金		653,604.39	1,487,087.18
存出保证金		209,689.58	270,424.14
交易性金融资产		118,445,872.53	172,173,560.31
其中：股票投资		118,445,872.53	172,173,560.31
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		—	—
买入返售金融资产		—	—
应收证券清算款		1,443,158.08	—
应收利息		3,287.80	2,741.55
应收股利		—	—
应收申购款		18,315.47	34,294.79
递延所得税资产		—	—
其他资产		—	—
资产总计		140,005,456.29	186,963,397.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
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		—	1,546,304.23
应付赎回款		128,140.23	241,797.65
应付管理人报酬		166,854.35	236,112.92
应付托管费		27,809.04	39,352.16
应付销售服务费		—	—
应付交易费用		315,900.84	520,994.31
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债		184,765.75	320,481.47
负债合计		823,470.21	2,905,042.74
所有者权益:			
实收基金		80,664,824.39	80,803,189.23

未分配利润		58,517,161.69	103,255,165.34
所有者权益合计		139,181,986.08	184,058,354.57
负债和所有者权益总计		140,005,456.29	186,963,397.31

注：(1)后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(2)报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.725元，基金份额总额80,664,824.39份。

6.2 利润表

会计主体：财通可持续发展主题混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
一、收入		-31,199,742.35	296,132,058.32
1.利息收入		146,159.82	295,401.69
其中：存款利息收入		133,240.80	284,690.57
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		12,919.02	10,711.12
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		-15,777,812.73	270,253,356.25
其中：股票投资收益		-15,946,595.50	269,243,922.07
基金投资收益		—	—
债券投资收益		—	—
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		168,782.77	1,009,434.18
3.公允价值变动收益（损失以		-15,641,137.19	23,772,614.88

“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		—	—
5.其他收入(损失以“-”号填列)		73,047.75	1,810,685.50
减：二、费用		2,914,876.27	14,838,075.98
1. 管理人报酬		1,046,628.67	4,275,059.61
2. 托管费		174,438.08	712,509.95
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用		1,561,520.42	9,712,380.33
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用		132,289.10	138,126.09
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-34,114,618.62	281,293,982.34
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-34,114,618.62	281,293,982.34

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

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混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016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)	80,803,189.23	103,255,165.34	184,058,354.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-34,114,618.62	-34,114,618.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	-138,364.84	3,035,996.13	2,897,631.29

“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	35,541,909.59	30,030,843.70	65,572,753.29
2.基金赎回款	-35,680,274.43	-26,994,847.57	-62,675,122.00
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）	—	-13,659,381.16	-13,659,381.16
五、期末所有者权益（基金净值）	80,664,824.39	58,517,161.69	139,181,986.08
项 目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	278,799,418.07	214,672,997.49	493,472,415.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	281,293,982.34	281,293,982.34
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)	-123,540,259.55	-172,240,923.49	-295,781,183.04
其中：1.基金申购款	508,875,931.79	656,350,391.13	1,165,226,322.92
2.基金赎回款	-632,416,191.34	-828,591,314.62	-1,461,007,505.96
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）	—	-84,557,239.22	-84,557,239.22
五、期末所有者权益（基金净值）	155,259,158.52	239,168,817.12	394,427,975.64

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混合型证券投资基金（原“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颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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2016年6月30日的财务状况以及2016年1月1日至2015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、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、其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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[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、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政

策的补充通知》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

3. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》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。

4. 个人所得税

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》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》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[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；

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、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8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，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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。

6.4.7.2 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
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
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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	—	—	356,372,780.10	5.16%

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

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 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金	期末应付佣金	占期末应付佣

		总量的比例	余额	金总额的比例
财通证券	—	—	—	—
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	320,157.98	6.05%		—

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。

6.4.8.2 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 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,046,628.67	4,275,059.61
其中：支付销售机构的客户维护费	480,388.54	1,907,236.04

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日

当期发生的基金应支付的托管费	174,438.08	712,509.95
----------------	------------	------------

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。

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。

6.4.8.4 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

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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	19,231,528.44	122,774.56	16,793,426.19	201,666.36

注：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。

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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末（2016年6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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新发流通受限	10.05	10.05	872	8,763.60	8,763.60
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新发流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80

6.4.9.2 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
300166	东方国信	2016-06-08	重大资产重组	27.47	—	—	71,700	1,852,800.00	1,969,599.00
600556	慧球科技	2016-01-19	重大资产重组	15.80	2016-07-07	14.22	66,100	1,910,237.00	1,044,380.00
601611	中国核建	2016-06-30	交易异常波动	20.92	2016-07-01	23.01	3,529	12,245.63	73,826.68

注：流通受限股票的复牌日期以上市公司发布的公告时间为准。

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因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

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因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

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	118,445,872.53	84.60
	其中：股票	118,445,872.53	84.60

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	19,885,132.83	14.20
7	其他各项资产	1,674,450.93	1.20
8	合计	140,005,456.29	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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	76,729,138.87	55.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	73,826.68	0.05
F	批发和零售业	2,833,877.46	2.04
G	交通运输、仓储和邮政业	3,831,000.00	2.75
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,679,423.29	18.45
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—

O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	4,834,949.49	3.47
R	文化、体育和娱乐业	4,463,656.74	3.21
S	综合	—	—
	合计	118,445,872.53	85.10

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通机制投资的港股。

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	300017	网宿科技	89,618	6,022,329.60	4.33
2	300033	同花顺	72,700	5,921,415.00	4.25
3	300136	信维通信	267,040	5,597,158.40	4.02
4	002582	好想你	133,268	5,266,751.36	3.78
5	600006	东风汽车	506,600	4,493,542.00	3.23
6	300068	南都电源	203,666	4,452,138.76	3.20
7	300296	利亚德	139,245	4,408,496.70	3.17
8	000957	中通客车	91,074	4,134,759.60	2.97
9	002245	澳洋顺昌	300,000	3,831,000.00	2.75
10	300014	亿纬锂能	87,721	3,788,669.99	2.72

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人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	601988	中国银行	13,561,022.00	7.37
2	601939	建设银行	9,569,494.13	5.20
3	300031	宝通科技	9,090,791.84	4.94
4	600115	东方航空	8,399,310.00	4.56
5	300264	佳创视讯	8,286,652.00	4.50
6	300017	网宿科技	7,905,300.38	4.30
7	600489	中金黄金	7,620,898.50	4.14
8	002582	好想你	7,392,631.36	4.02
9	600547	山东黄金	7,249,082.00	3.94
10	300271	华宇软件	7,197,286.92	3.91
11	300324	旋极信息	7,070,277.76	3.84
12	002450	康得新	6,558,375.00	3.56
13	002343	慈文传媒	6,344,867.86	3.45
14	300166	东方国信	6,238,775.50	3.39
15	002640	跨境通	5,968,518.90	3.24
16	600009	上海机场	5,691,060.10	3.09
17	300383	光环新网	5,639,298.00	3.06
18	300008	天海防务	5,615,386.01	3.05
19	300033	同花顺	5,561,670.04	3.02
20	002464	金利科技	5,430,391.00	2.95
21	002415	海康威视	5,374,856.17	2.92
22	002475	立讯精密	5,355,251.00	2.91
23	300367	东方网力	5,308,643.19	2.88
24	002368	太极股份	5,257,860.16	2.86
25	002395	双象股份	5,243,159.00	2.85
26	601111	中国国航	5,232,212.00	2.84
27	600029	南方航空	5,229,391.00	2.84
28	300136	信维通信	5,178,610.31	2.81
29	000971	高升控股	5,154,476.30	2.80
30	601021	春秋航空	5,072,837.00	2.76
31	600076	康欣新材	5,055,572.98	2.75

32	002405	四维图新	4,836,639.50	2.63
33	300160	秀强股份	4,744,151.00	2.58
34	002580	圣阳股份	4,722,769.75	2.57
35	002196	方正电机	4,713,910.28	2.56
36	000333	美的集团	4,670,205.10	2.54
37	002664	信质电机	4,606,492.00	2.50
38	000957	中通客车	4,447,588.00	2.42
39	002655	共达电声	4,438,482.00	2.41
40	300073	当升科技	4,377,090.00	2.38
41	000858	五粮液	4,372,920.00	2.38
42	600519	贵州茅台	4,362,777.00	2.37
43	600718	东软集团	4,312,511.00	2.34
44	000700	模塑科技	4,285,242.68	2.33
45	601169	北京银行	4,264,144.00	2.32
46	300229	拓尔思	4,195,228.60	2.28
47	300068	南都电源	4,190,169.20	2.28
48	000776	广发证券	4,085,316.00	2.22
49	600079	人福医药	3,998,876.00	2.17
50	300481	濮阳惠成	3,973,783.00	2.16
51	300296	利亚德	3,971,670.47	2.16
52	600006	东风汽车	3,959,297.00	2.15
53	000750	国海证券	3,817,742.00	2.07
54	002425	凯撒股份	3,805,989.00	2.07
55	300014	亿纬锂能	3,781,815.90	2.05

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	600155	宝硕股份	28,612,281.68	15.55

2	300160	秀强股份	13,650,716.36	7.42
3	601988	中国银行	13,374,450.65	7.27
4	002502	骅威文化	13,285,067.25	7.22
5	002425	凯撒股份	10,389,153.89	5.64
6	300324	旋极信息	10,196,761.59	5.54
7	601939	建设银行	9,273,630.05	5.04
8	002239	奥特佳	9,118,854.48	4.95
9	300031	宝通科技	8,597,218.02	4.67
10	300271	华宇软件	8,398,657.97	4.56
11	002655	共达电声	8,223,074.50	4.47
12	600115	东方航空	7,660,344.80	4.16
13	600489	中金黄金	7,648,552.20	4.16
14	600547	山东黄金	7,578,754.70	4.12
15	300310	宜通世纪	7,187,791.22	3.91
16	002474	榕基软件	7,076,233.53	3.84
17	300264	佳创视讯	6,820,960.00	3.71
18	300093	金刚玻璃	6,755,958.68	3.67
19	002450	康得新	6,572,603.36	3.57
20	300078	思创医惠	6,518,624.94	3.54
21	002343	慈文传媒	6,305,457.97	3.43
22	300008	天海防务	6,225,205.98	3.38
23	300229	拓尔思	5,689,751.64	3.09
24	300166	东方国信	5,654,772.70	3.07
25	600009	上海机场	5,598,544.00	3.04
26	002415	海康威视	5,523,729.62	3.00
27	002368	太极股份	5,322,526.67	2.89
28	300383	光环新网	5,281,744.64	2.87
29	002475	立讯精密	5,171,848.02	2.81
30	000858	五粮液	5,142,196.30	2.79
31	002464	金利科技	5,020,026.62	2.73
32	300098	高新兴	5,013,771.18	2.72

33	300481	濮阳惠成	4,984,996.75	2.71
34	000333	美的集团	4,894,096.13	2.66
35	600519	贵州茅台	4,864,721.00	2.64
36	600029	南方航空	4,862,170.03	2.64
37	601021	春秋航空	4,857,756.50	2.64
38	300367	东方网力	4,674,691.70	2.54
39	601111	中国国航	4,669,044.00	2.54
40	002395	双象股份	4,647,180.40	2.52
41	002405	四维图新	4,604,722.50	2.50
42	000971	高升控股	4,569,399.40	2.48
43	600718	东软集团	4,543,208.05	2.47
44	300073	当升科技	4,384,339.00	2.38
45	300113	顺网科技	4,289,360.60	2.33
46	600079	人福医药	4,271,881.20	2.32
47	601169	北京银行	4,210,688.00	2.29
48	000776	广发证券	4,034,130.20	2.19
49	000750	国海证券	3,968,190.93	2.16
50	002458	益生股份	3,932,841.24	2.14
51	600549	厦门钨业	3,739,626.56	2.03
52	000700	模塑科技	3,710,984.45	2.02
53	300097	智云股份	3,689,873.82	2.00

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	547,972,677.51
卖出股票的收入（成交）总额	570,112,632.60

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

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 2015年9月2日，中国证监会发布新闻称浙江核新同花顺网络信息股份有限公司(同花顺，股票代码：300033.SZ)涉嫌非法经营，拟对其实行行政处罚，没收其违法所得

2,176,997.22元，并处以6,530,991.66元罚款。报告期内，本基金投资的其他前九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。

本基金投资同花顺（股票代码：300033.SZ）的投资决策程序为：

- 1、投资决策委员会确定每个产品的基本投资逻辑；
- 2、投资研究体系中的研究平台是一个共享平台，为投资决策全流程提供研究支持；
- 3、基金经理拟订所管理产品的投资计划与方案；
- 4、金融工程小组对基金经理/投资经理的投资计划进行风险评价，并向投资决策委员会提交评估报告；
- 5、投资决策委员会对基金经理/投资经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要；
- 6、根据决策纪要，基金经理/投资经理对计划方案进行具体实施；
- 7、中央交易室按有关交易规则执行基金经理/投资经理下达的交易指令，并将有关信息进行反馈；
- 8、基金经理/投资经理定期检讨投资组合的运作成效；
- 9、金融工程小组定期为投资决策委员会、投资总监、基金经理/投资经理出具绩效与风险评估报告。

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	209,689.58
2	应收证券清算款	1,443,158.08
3	应收股利	—
4	应收利息	3,287.80
5	应收申购款	18,315.47
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,674,450.93

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。

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
7,080	11,393.34	268,422.53	0.33%	80,396,401.86	99.67%

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	12,527.34	0.02%

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	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
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(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	80,803,189.23
本报告期基金总申购份额	35,541,909.59
减：本报告期基金总赎回份额	35,680,274.43
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	80,664,824.39

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、本基金管理人于2016年5月11日增聘夏钦先生为本基金基金经理；
- 2、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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。

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	
安信证券	4	124,827, 336.22	11.17%	89,464.67	10.03%	—
长城证券	1	4,401,15 7.14	0.39%	3,218.31	0.36%	—
长江证券	2	41,664,3 10.18	3.73%	30,033.18	3.37%	—
东方证券	2	27,310,9 97.05	2.44%	19,486.52	2.18%	—
方正证券	1	146,372, 863.04	13.1%	104,115.27	11.67%	—
国金证券	2	171,283, 439.66	15.33%	157,152.71	17.61%	—
国信证券	2	20,362,9 77.64	1.82%	14,565.07	1.63%	—
华创证券	1	72,123,5 72.76	6.45%	52,743.47	5.91%	—
华融证券	2	34,432,7 19.76	3.08%	24,520.89	2.75%	—
华泰证券	2	103,912, 475.57	9.3%	75,291.65	8.44%	—
联讯证券	1	14,158,9 04.26	1.27%	12,902.96	1.45%	—
民族证券	2	13,647,5 77.88	1.22%	9,807.09	1.1%	—
山西证券	1	15,010,3 44.45	1.34%	10,676.75	1.2%	—
申银万国	2	118,535, 191.4	10.61%	108,848.08	12.2%	—
湘财证券	2	111,541, 782.52	9.98%	102,060.65	11.44%	—
信达证券	1	2,356,82 5.34	0.21%	1,676.38	0.19%	—

银河证券	2	57,465,418.85	5.14%	41,017.88	4.6%	—
招商证券	2	35,090,649.08	3.14%	31,991.6	3.59%	—
中信证券	2	2,964,529.8	0.27%	2,705.16	0.3%	—

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	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
安信证券	—	—	—	—	—	—
长城证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
国金证券	—	—	37,500,000	69.06%	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—	—	—
华融证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	16,800,000	30.94%	—	—
联讯证券	—	—	—	—	—	—
民族证券	—	—	—	—	—	—
山西证券	—	—	—	—	—	—
申银万国	—	—	—	—	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—

中信证券	—	—	—	—	—	—
------	---	---	---	---	---	---

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。

财通基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日