

财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金2017年半年度报告

2017年06月30日

基金管理人：财通证券资产管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017年08月24日

## § 1 重要提示及目录

### 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2017年8月22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。

本报告期自2017年1月1日起至2017年6月30日止。

## 1.2 目录

|      |                                     |    |
|------|-------------------------------------|----|
| § 1  | 重要提示及目录                             | 2  |
| § 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                         | 5  |
| 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                       | 6  |
| 3.1  | 主要会计数据和财务指标                         | 6  |
| 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合规守信情况的说明              | 10 |
| 4.3  | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10 |
| 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             | 10 |
| 4.5  | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11 |
| 4.6  | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11 |
| 4.7  | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12 |
| § 5  | 托管人报告                               | 12 |
| 5.1  | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12 |
| 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 | 12 |
| 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     | 13 |
| § 6  | 半年度财务会计报告（未经审计）                     | 13 |
| 6.1  | 资产负债表                               | 13 |
| 6.2  | 利润表                                 | 15 |
| 6.3  | 所有者权益（基金净值）变动表                      | 16 |
| 6.4  | 报表附注                                | 18 |
| § 7  | 投资组合报告                              | 39 |
| 7.1  | 期末基金资产组合情况                          | 39 |
| 7.2  | 期末按行业分类的股票投资组合                      | 39 |
| 7.3  | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细         | 40 |
| 7.4  | 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 41 |
| 7.5  | 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 43 |
| 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      | 43 |
| 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   | 43 |
| 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   | 44 |
| 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      | 44 |
| 7.10 | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明                | 44 |
| 7.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明                | 44 |
| 7.12 | 投资组合报告附注                            | 44 |
| § 8  | 基金份额持有人信息                           | 45 |
| 8.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 45 |
| 8.2  | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况             | 46 |
| 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        | 46 |
| 8.4  | 发起式基金发起资金持有份额情况                     | 46 |
| § 9  | 开放式基金份额变动                           | 47 |
| § 10 | 重大事件揭示                              | 47 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议                         | 47 |
| 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         | 47 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼              | 47 |

|      |                                   |    |
|------|-----------------------------------|----|
| 10.4 | 基金投资策略的改变.....                    | 47 |
| 10.5 | 基金改聘会计师事务所情况.....                 | 47 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况..... | 48 |
| 10.7 | 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....          | 48 |
| 10.8 | 其他重大事件.....                       | 49 |
| § 11 | 影响投资者决策的其他重要信息.....               | 50 |
| § 12 | 备查文件目录.....                       | 51 |
| 12.1 | 备查文件目录.....                       | 51 |
| 12.2 | 存放地点.....                         | 51 |
| 12.3 | 查阅方式.....                         | 51 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                     |                      |                |
|---------------------|----------------------|----------------|
| 基金名称                | 财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金 |                |
| 基金简称                | 财通资管积极收益债券           |                |
| 基金主代码               | 002901               |                |
| 基金运作方式              | 契约型开放式               |                |
| 基金合同生效日             | 2016年07月19日          |                |
| 基金管理人               | 财通证券资产管理有限公司         |                |
| 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          | 515,130,663.09       |                |
| 基金合同存续期             | 不定期                  |                |
| 下属分级基金的基金简称         | 财通资管积极收益债券A          | 财通资管积极收益债券C    |
| 下属分级基金的交易代码         | 002901               | 002902         |
| 报告期末下属分级基金的份<br>额总额 | 142,606,320.09       | 372,524,343.00 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                          |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在有效控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。                                                                                                                                           |
| 投资策略   | 本基金将充分发挥基金管理人的投研能力,采取自上而下的方法对基金的大类资产进行动态配置,综合久期管理、收益率曲线配置等策略对个券进行精选,力争在严格控制基金风险的基础上,获取长期稳定超额收益。另外,本基金可投资于股票、权证等权益类资产,基金管理人将选择估值合理、具有持续竞争优势和较大成长空间的个股进行投资,强化基金的获利能力,提高预期收益水平,以期达到收益增强的效果。 |
| 业绩比较基准 | 中债总指数(全价)收益率                                                                                                                                                                             |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。                                                                                                                                              |

### 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      |      | 财通证券资产管理有限公司            | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 钱慧                      | 郭明                  |
|         | 联系电话 | 021-20568207            | 010-66105799        |
|         | 电子邮箱 | qianh@ctzg.com          | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 95336                   | 95588               |
| 传真      |      | 021-68753502            | 010-66105798        |
| 注册地址    |      | 浙江省杭州市上城区白云路26号143室     | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 办公地址    |      | 上海市浦东新区福山路500号城建国际大厦28楼 | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 邮政编码    |      | 200122                  | 100140              |
| 法定代表人   |      | 马晓立                     | 易会满                 |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                        |
|----------------------|------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.ctzg.com           |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人住所          |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                   | 办公地址                |
|--------|----------------------|---------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市湖滨路202号普华永道中心11楼 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司       | 北京市西城区太平桥大街17号      |

## § 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

单位：人民币元

|               | 报告期（2017年01月01日至2017年06月30日） |                |
|---------------|------------------------------|----------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 财通资管积极收益债券A                  | 财通资管积极收益债券C    |
| 本期已实现收益       | -166,799.71                  | -1,379,107.59  |
| 本期利润          | 3,522,958.53                 | 7,346,199.51   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0207                       | 0.0196         |
| 本期基金加权平均净值利润率 | 2.04%                        | 1.93%          |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.97%                        | 1.78%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2017年06月30日）            |                |
| 期末可供分配利润      | 2,233,325.05                 | 4,353,997.33   |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0157                       | 0.0117         |
| 期末基金资产净值      | 147,372,954.70               | 383,469,880.12 |
| 期末基金份额净值      | 1.033                        | 1.029          |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2016年7月19日至2017年6月30日        |                |
| 基金份额累计净值增长率   | 3.30%                        | 2.90%          |

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<br>(财通资管积极收益债券A) | 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               | 1.97%    | 0.07%       | 0.88%      | 0.10%         | 1.09% | -0.03% |
| 过去三个月               | 1.08%    | 0.13%       | -1.04%     | 0.11%         | 2.12% | 0.02%  |
| 过去六个月               | 1.97%    | 0.11%       | -2.47%     | 0.11%         | 4.44% | 0.00%  |

|                     |          |             |            |               |       |        |
|---------------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 自基金合同生效日起至今         | 3.30%    | 0.10%       | -4.06%     | 0.13%         | 7.36% | -0.03% |
| 阶段<br>(财通资管积极收益债券C) | 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               | 1.88%    | 0.07%       | 0.88%      | 0.10%         | 1.00% | -0.03% |
| 过去三个月               | 0.88%    | 0.14%       | -1.04%     | 0.11%         | 1.92% | 0.03%  |
| 过去六个月               | 1.78%    | 0.11%       | -2.47%     | 0.11%         | 4.25% | 0.00%  |
| 自基金合同生效日起至今         | 2.90%    | 0.11%       | -4.06%     | 0.13%         | 6.96% | -0.02% |

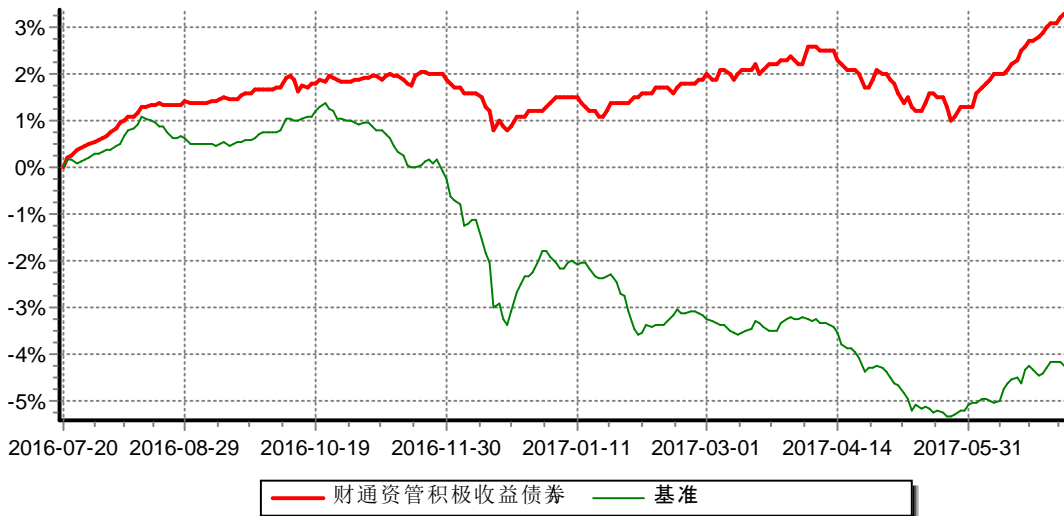
注：自基金合同生效至报告期末，财通资管积极收益债券A基金份额净值增长率为3.3%，同期业绩比较基准收益率为-4.06%；财通资管积极收益债券C基金份额净值增长率为2.9%，同期业绩比较基准收益率为-4.06%。

### 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

#### 财通资管积极收益债券A

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7月19日-2017年6月30日)

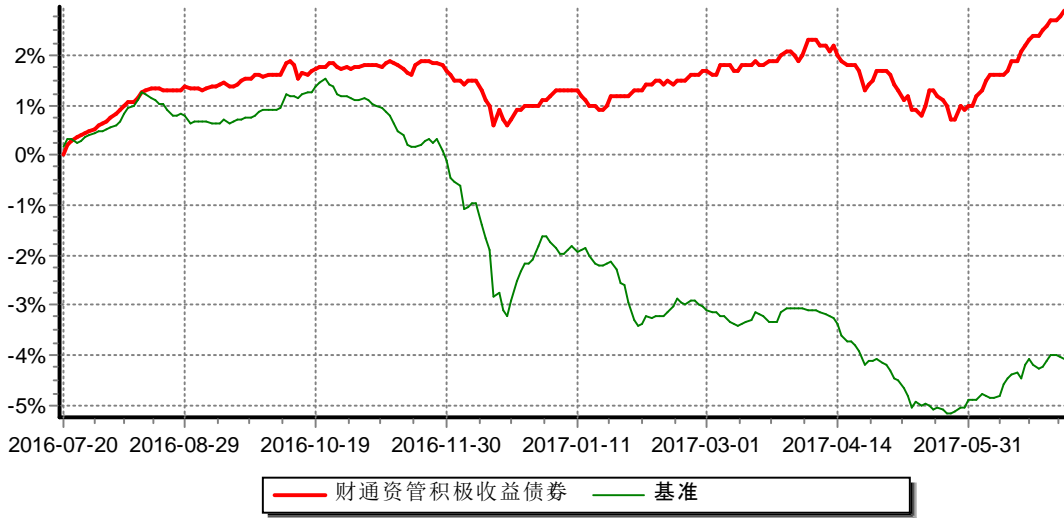


#### 财通资管积极收益债券C

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7月19日-2017年6月30日)





注：1、本基金合同于2016年7月19日生效，自合同起至本报告期末不满一年。

2、本基金建仓期6个月，即从2016年7月29日起至2017年1月28日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## § 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

财通证券资产管理有限公司系财通证券股份有限公司的全资子公司，注册资本2亿元人民币。2015年12月，公司获准开展公开募集证券投资基金管理业务。截至2017年6月30日，公司共管理2只基金，分别为财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金和财通资管鑫管家货币市场基金。

#### 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期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                    |
|----|------------------------|-------------|------|--------|---------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                        | 任职日期        | 离任日期 |        |                                                                                       |
| 张波 | 本基金基金经理、财通资管鑫管家货币市场基金基 | 2016年08月15日 | —    | 8      | 中南财经政法大学财政学学士。2007年8月至2013年8月期间于平安资产管理有限公司担任集中交易部债券交易员，2014年7月至2016年5月期间担任平安养老保险股份有限公 |

|  |     |  |  |  |                 |
|--|-----|--|--|--|-----------------|
|  | 金经理 |  |  |  | 司资产管理事业部债券交易主管。 |
|--|-----|--|--|--|-----------------|

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》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，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金基金合同》、《财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。本报告期内，基金运作合法合规，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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通证券资产管理有限公司公平交易管理办法》等规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。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，本基金与本公司管理的其他基金在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

## 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

上半年经济基本面整体强于市场预期。一季度宏观经济数据表现较好，2月CPI同比上涨0.8%，大幅低于预期，主要由于食品降幅仍较大；PPI同比上涨7.8%，环比仍上涨较快，3月PPI有所放缓但仍维持在高位。一季度全国制造业PMI均维持在51以上，景气度较高。1-2月固定资产合计同比上涨9.2%，其中，房地产开发投资累计同比上涨9.1%。二季度宏观经济数据表现偏弱，受房地产调控政策加码，最新的投资和开工数据均出现边际下滑。物价方面，目前CPI处于低位，整体通胀压力不大。5月CPI同比上涨1.5%，较上月上升30bp，主要受医疗保健、教育服务、居住和交通等非食品项上升影响；PPI

同比上涨5.5%，增速连续3个月下降，5月PPI环比下降0.3%，6月PPI同比数据与5月持平。5月中国制造业PMI为51.2%，与上月持平。进出口方面，5月进口增速小幅回升，同比上涨14.8%，大宗商品中，多数产品进口量同比回升；出口同比上涨8.7%，略有回升；贸易顺差2816亿元。固定投资方面，5月固定资产投资同比增速7.8%，较上月下滑0.3个百分点，其中基建和房地产开发投资大幅回落，未来投资仍面临下行压力。金融数据方面，5月新增社融1.06万亿，同比增长3855亿元，结构上，表外转向表内，债券、非标转向信贷趋势明显；M2同比增速9.6%，创近两年新低，存款增速下降，同业、资管、表外业务扩张均有放缓，金融去杠杆初显成效。

从海外因素来看，近期全球经济略有改善。3月份美联储加息靴子落地；国内政策从稳增长转向去杠杆防风险。在国内外因素影响下，10年国债收益率从1月初的3.10%震荡走升到3月底的3.28%，期限利差有所收窄。二季度主要欧元区表现较好，美国经济数据短期不及预期，出现小波动。年初以来，美债呈震荡下行状态，国内外债券收益率走势出现背离，主因2016年10月底以来我国出台的一系列监管措施，10年国债收益率从3月初的3.325%震荡走升到6月底的3.548%，期限利差有所收窄。

本组合上半年风格较为稳健，年初捕捉到短久期品种收益率大幅下行的机会，同时在二季度市场开始调整前继续保持了短久期高评级配置。并在股市超预期调整后的反弹中继续增持了银行、家电等标的，为投资者获取了稳健的回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，财通资管积极收益债券A基金份额净值增长率为1.97%，同期业绩比较基准收益率为-2.47%，超越业绩比较基准4.44%；财通资管积极收益债券C基金份额净值增长率为1.78%，同期业绩比较基准收益率为-2.47%，超越业绩比较基准4.25%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期债市风险还在于金融监管和去杠杆导向下的市场流动性的不确定，以及经济基本面弱复苏的持续性。随着半年末结束，7月份债券市场将有大量逆回购到期，需关注资金面情况。若后续固定资产投资下降、房地产市场调控继续作用于基本面，可能带来债券市场收益率下行的机会。权益方面，2017年上半年股票市场的风格偏价值，因此我们看到各大行业的龙头白马股受到市场追捧涨幅巨大。我们的权益组合在均衡配置的基础上也择优布局了部分大市值白马股，因此上半年的表现也相当不错。展望下半年，我们认为白马股的交易已略显拥挤，获取超额收益的难度在加大，市场资金有向二线价值成长股扩散的迹象。因此下半年我们计划主要在创业板和中证500成分股中精选部分具有核心竞争力的优质成长股，期望能为投资者带来不错的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，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。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署提供中债收益率曲线和中债估值的服务协议，由其按约定提供银行间同业市场债券品种的估值数据。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内无利润分配。

#### 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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额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

本报告期内，本基金托管人在对财通资管积极收益债券型发起式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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金的管理人——财通证券资产管理有限公司在财通资管积极收益债券型发起式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，财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金未进行利润分配。

### 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证券资产管理有限公司编制和披露的财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金2017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：财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2017年06月30日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2017年06月30日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 26,173,427.05      | 105,229,295.40      |
| 结算备付金      |         | 2,838,464.49       | 331,083.92          |
| 存出保证金      |         | 143,284.73         | 326,315.89          |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 595,888,081.40     | 296,456,477.25      |
| 其中：股票投资    |         | 18,067,180.00      | 35,970,554.00       |
| 基金投资       |         | —                  | —                   |
| 债券投资       |         | 577,820,901.40     | 260,485,923.25      |
| 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 | —                  | 270,000,420.00      |
| 应收证券清算款    |         | —                  | 2,628,008.05        |
| 应收利息       | 6.4.7.5 | 13,773,455.21      | 7,202,900.33        |
| 应收股利       |         | —                  | —                   |
| 应收申购款      |         | 120,323.40         | 93,501.98           |
| 递延所得税资产    |         | —                  | —                   |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 其他资产            |            | —                          | —                           |
| 资产总计            |            | 638,937,036.28             | 682,268,002.82              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2016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          |            | —                          | —                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | 106,999,244.00             | —                           |
| 应付证券清算款         |            | 9,923.41                   | —                           |
| 应付赎回款           |            | 204,958.92                 | 5,452,592.84                |
| 应付管理人报酬         |            | 340,045.75                 | 493,436.88                  |
| 应付托管费           |            | 85,011.47                  | 134,526.85                  |
| 应付销售服务费         |            | 121,532.01                 | 388,982.40                  |
| 应付交易费用          | 6.4.7.6    | 110,170.71                 | 584,844.64                  |
| 应交税费            |            | —                          | —                           |
| 应付利息            |            | 25,735.47                  | —                           |
| 应付利润            |            | —                          | —                           |
| 递延所得税负债         |            | —                          | —                           |
| 其他负债            | 6.4.7.7    | 197,579.72                 | 81,643.78                   |
| 负债合计            |            | 108,094,201.46             | 7,136,027.39                |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金            | 6.4.7.8    | 515,130,663.09             | 667,572,288.24              |
| 未分配利润           | 6.4.7.9    | 15,712,171.73              | 7,559,687.19                |
| 所有者权益合计         |            | 530,842,834.82             | 675,131,975.43              |
| 负债和所有者权益总计      |            | 638,937,036.28             | 682,268,002.82              |

注：1、本基金合同生效日为2016年7月19日，2017年度实际报告期间为2017年1月1日至2017年6月30日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2、报告截止日2017年6月30日，A类基金份额净值1.033元，C类基金份额净值1.029元；基金份额总额515,130,663.09份，下属分级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额142,606,320.09份，C类基金份额总额372,524,343.00份。

## 6.2 利润表

会计主体：财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金

本报告期：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号                | 本期<br>2017年01月01日-2017<br>年06月30日 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日-2016<br>年06月30日 |
|-------------------|--------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 一、收入              |                    | 16,603,005.10                     | —                                      |
| 1. 利息收入           |                    | 14,553,486.42                     | —                                      |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.<br>7.10       | 134,914.59                        | —                                      |
| 债券利息收入            |                    | 14,037,904.26                     | —                                      |
| 资产支持证券利息收入        |                    | —                                 | —                                      |
| 买入返售金融资产收入        |                    | 380,667.57                        | —                                      |
| 其他利息收入            |                    | —                                 | —                                      |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |                    | -10,400,539.70                    | —                                      |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.<br>7.11       | -5,272,584.48                     | —                                      |
| 基金投资收益            |                    | —                                 | —                                      |
| 债券投资收益            | 6.4.<br>7.12       | -4,837,821.61                     | —                                      |
| 资产支持证券投资收益        | 6.4.<br>7.12<br>.3 | —                                 | —                                      |
| 贵金属投资收益           | 6.4.<br>7.13       | —                                 | —                                      |
| 衍生工具收益            | 6.4.<br>7.14       | -380,800.00                       | —                                      |
| 股利收益              | 6.4.               | 90,666.39                         | —                                      |

|                            |              |               |   |
|----------------------------|--------------|---------------|---|
|                            | 7.15         |               |   |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”填列)      | 6.4.<br>7.16 | 12,415,065.34 | — |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)         |              | —             | — |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列)         | 6.4.<br>7.17 | 34,993.04     | — |
| <b>减：二、费用</b>              |              | 5,733,847.06  | — |
| 1. 管理人报酬                   |              | 2,200,590.35  | — |
| 2. 托管费                     |              | 550,147.67    | — |
| 3. 销售服务费                   |              | 754,798.45    | — |
| 4. 交易费用                    | 6.4.<br>7.18 | 252,757.83    | — |
| 5. 利息支出                    |              | 1,745,276.61  | — |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |              | 1,745,276.61  | — |
| 6. 其他费用                    | 6.4.<br>7.19 | 230,276.15    | — |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> |              | 10,869,158.04 | — |
| 减：所得税费用                    |              | —             | — |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   |              | 10,869,158.04 | — |

注：本基金合同于2016年7月19日生效，本报告期自2017年1月1日至2017年6月30日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金

本报告期：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2017年01月01日-2017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)                        | 667,572,288.24                     | 7,559,687.19  | 675,131,975.43  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | —                                  | 10,869,158.04 | 10,869,158.04   |
| 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)      | -152,441,625.15                    | -2,716,673.50 | -155,158,298.65 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 97,270,762.69                      | 1,617,139.06  | 98,887,901.75   |
| 2. 基金赎回款                               | -249,712,387.84                    | -4,333,812.56 | -254,046,200.40 |
| 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)                        | 515,130,663.09                     | 15,712,171.73 | 530,842,834.82  |
| 项 目                                    | 上年度可比期间<br>2016年01月01日-2016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)                        | —                                  | —             | —               |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | —                                  | —             | —               |
| 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)      | —                                  | —             | —               |
| 其中：1. 基金申购款                            | —                                  | —             | —               |
| 2. 基金赎回款                               | —                                  | —             | —               |
| 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)                        | —                                  | —             | —               |

注：本基金合同生效日为2016年7月19日，本报告期为2017年1月1日至2017年6月30日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

|           |           |         |
|-----------|-----------|---------|
| 马晓立       | 刘博        | 刘博      |
| -----     | -----     | -----   |
| 基金管理公司负责人 | 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

财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2016]1155号文《关于准予财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由财通证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,342,480,754.11元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第975号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金基金合同》于2016年7月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,342,719,980.43份基金份额,其中认购资金利息折合239,226.32份基金份额。本基金的基金管理人为财通证券资产管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金基金合同》和《财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金招募说明书》的规定,本基金自募集期起根据认购/申购费用与销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。认购/申购时收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费,而不计提销售服务费,称为A类基金份额;认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,各类基金份额分别计算基金份额净值。

投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《财通资管积极收益债券型发起式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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股

票)、债券(含国家债券、地方债券、政府支持机构债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、证券公司发行的短期公司债券)、债券回购、协议存款、通知存款、定期存款、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、国债期货以及经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)。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;投资于股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%,其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为中债总指数(全价)收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外,本财务报表同时符合如会计报表附注6.4.2所列示的其他有关规定的要求。

#### 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、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

本基金报告期末未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、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]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股票的股息、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) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按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) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

| 项目           | 本期末<br>2017年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 26,173,427.05      |
| 定期存款         | —                  |
| 其中：存款期限1-3个月 | —                  |
| 其他存款         | —                  |
| 合计           | 26,173,427.05      |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末2017年06月30日 |               |            |
|----|----------------|---------------|------------|
|    | 成本             | 公允价值          | 估值增值       |
| 股票 | 17,704,895.90  | 18,067,180.00 | 362,284.10 |

|               |       |                |                |              |
|---------------|-------|----------------|----------------|--------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | —              | —              | —            |
| 债券            | 交易所市场 | 180,790,601.54 | 186,626,501.40 | 5,835,899.86 |
|               | 银行间市场 | 391,930,572.14 | 391,194,400.00 | -736,172.14  |
|               | 合计    | 572,721,173.68 | 577,820,901.40 | 5,099,727.72 |
| 资产支持证券        |       | —              | —              | —            |
| 其他            |       | —              | —              | —            |
| 合计            |       | 590,426,069.58 | 595,888,081.40 | 5,462,011.82 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

| 项目     | 本期末2017年06月30日 |      |    |    |
|--------|----------------|------|----|----|
|        | 合同/名义金额        | 公允价值 |    | 备注 |
|        |                | 资产   | 负债 |    |
| 权益衍生工具 | 2,864,250.00   | —    | —  |    |
| 其他衍生工具 | —              | —    | —  |    |
| 合计     | 2,864,250.00   | —    | —  |    |

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

#### 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

本基金于本报告期末，未持有任何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:2017年06月30日 |
|-----------|-----------------|
| 应收活期存款利息  | 11,621.04       |
| 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 | 141.20          |

|            |               |
|------------|---------------|
| 应收债券利息     | 13,761,667.07 |
| 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         | 25.90         |
| 合计         | 13,773,455.21 |

注：其他指应收权证保证金利息。

#### 6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末 2017年06月30日 |
|-------------|-----------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 89,846.65       |
| 银行间市场应付交易费用 | 20,324.06       |
| 合计          | 110,170.71      |

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                  |
| 应付赎回费       | 142.43             |
| 预提费用        | 197,437.29         |
| 合计          | 197,579.72         |

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目<br>(财通资管积极收益债券A) | 本期 2017年01月01日-2017年06月30日 |                 |
|---------------------|----------------------------|-----------------|
|                     | 基金份额(份)                    | 账面金额            |
| 上年度末                | 226,015,684.24             | 226,015,684.24  |
| 本期申购                | 19,628,379.94              | 19,628,379.94   |
| 本期赎回                | -103,037,744.09            | -103,037,744.09 |
| 期末数                 | 142,606,320.09             | 142,606,320.09  |
| 项目<br>(财通资管积极收益债券C) | 基金份额(份)                    | 账面金额            |

|      |                 |                 |
|------|-----------------|-----------------|
| 上年度末 | 441,556,604.00  | 441,556,604.00  |
| 本期申购 | 77,642,382.75   | 77,642,382.75   |
| 本期赎回 | -146,674,643.75 | -146,674,643.75 |
| 期末数  | 372,524,343.00  | 372,524,343.00  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

| 项目<br>(财通资管积极收益债券A) | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|---------------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末                | 4,319,509.09  | -1,486,071.61 | 2,833,437.48  |
| 本期利润                | -166,799.71   | 3,689,758.24  | 3,522,958.53  |
| 本期基金份额交易产生的变动数      | -1,919,384.33 | 329,622.93    | -1,589,761.40 |
| 其中：基金申购款            | 269,027.75    | 119,433.94    | 388,461.69    |
| 基金赎回款               | -2,188,412.08 | 210,188.99    | -1,978,223.09 |
| 本期已分配利润             | —             | —             | —             |
| 本期末                 | 2,233,325.05  | 2,533,309.56  | 4,766,634.61  |

单位：人民币元

| 项目<br>(财通资管积极收益债券C) | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|---------------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末                | 7,620,858.66  | -2,894,608.95 | 4,726,249.71  |
| 本期利润                | -1,379,107.59 | 8,725,307.10  | 7,346,199.51  |
| 本期基金份额交易产生的变动数      | -1,887,753.74 | 760,841.64    | -1,126,912.10 |
| 其中：基金申购款            | 831,851.53    | 396,825.84    | 1,228,677.37  |
| 基金赎回款               | -2,719,605.27 | 364,015.80    | -2,355,589.47 |
| 本期已分配利润             | —             | —             | —             |
| 本期末                 | 4,353,997.33  | 6,591,539.79  | 10,945,537.12 |

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|           | 2017年01月01日-2017年06月30日 |
|-----------|-------------------------|
| 活期存款利息收入  | 131,434.50              |
| 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 | 1,814.74                |
| 其他        | 1,665.35                |
| 合计        | 134,914.59              |

注：其他包括存出保证金利息收入。

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2017年01月01日-2017年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 90,398,597.50                 |
| 减：卖出股票成本总额 | 95,671,181.98                 |
| 买卖股票差价收入   | -5,272,584.48                 |

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                                    | 本期<br>2017年01月01日-2017年06月30日 |
|---------------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券<br>(、债转股及债券到期兑付)<br>差价收入 | -4,837,821.61                 |
| 债券投资收益——赎回差价<br>收入                    | —                             |
| 债券投资收益——申购差价<br>收入                    | —                             |
| 合计                                    | -4,837,821.61                 |

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元



| 项目                      | 本期<br>2017年01月01日-2017年06月30日 |
|-------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,070,648,492.17              |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,052,710,940.83              |
| 减：应收利息总额                | 22,775,372.95                 |
| 买卖债券差价收入                | -4,837,821.61                 |

#### 6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

##### 6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期收益金额<br>2017年01月01日-2017年06月30日 |
|-------------|-----------------------------------|
| 投资收益_中金所_套保 | -387,850.00                       |

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2017年01月01日-2017年06月30日 |
|-------------|-------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 90,666.39                     |
| 基金投资产生的股利收益 | —                             |
| 合计          | 90,666.39                     |

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2017年01月01日-2017年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 12,422,115.34                 |

|            |               |
|------------|---------------|
| ——股票投资     | 1,417,845.32  |
| ——债券投资     | 11,004,270.02 |
| ——资产支持证券投资 | —             |
| ——贵金属投资    | —             |
| 2. 衍生工具    | —             |
| ——权证投资     | —             |
| 3. 其他      | -7,050.00     |
| 合计         | 12,415,065.34 |

注：其他包括国债期货公允价值变动。

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2017年01月01日-2017年06月30日 |
|---------|-------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 34,993.04                     |
| 合计      | 34,993.04                     |

注：本基金赎回费和转换费的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<br>2017年01月01日-2017年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 231,803.32                    |
| 银行间市场交易费用 | 19,362.50                     |
| 期货交易费用    | 1,592.01                      |
| 合计        | 252,757.83                    |

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2017年01月01日-2017年06月30日 |
|-------|-------------------------------|
| 审计费用  | 39,671.58                     |
| 信息披露费 | 148,765.71                    |
| 帐户维护费 | 27,630.00                     |

|       |            |
|-------|------------|
| 汇划手续费 | 14,208.86  |
| 合计    | 230,276.15 |

#### 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

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的日后事项。

#### 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。

##### 6.4.9.2 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         |
|--------------|-----------------|
| 财通证券资产管理有限公司 | 管理人、基金销售机构      |
| 财通证券股份有限公司   | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 工商银行股份有限公司   | 托管人、基金销售机构      |

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。

#### 6.4.10 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<br>2017年01月01日-2017年06月30<br>日 |              | 上年度可比期间<br>2016年01月01日-2016年06月30<br>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 |
| 财通证券股份<br>有限公司 | 113,132,207.19                    | 67.85%       |                                        | —            |

注：本基金合同生效日为2016年7月19日，无上年度可比期间数据。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.3 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>2017年01月01日-2017年06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  | 占应付佣金余额的比例 |
| 财通证券股份有限公司 | 82,851.48                     | 67.88%     | 50,638.57 | 56.36%     |

注：1、本基金合同生效日为2016年7月19日，无上年度可比期间数据。

2、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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的净额列示。

3、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。

#### 6.4.10.1.4 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2017年01月01日-2017年06月30日 |              | 上年度可比期间<br>2016年01月01日-2016年06月30日 |              |
|------------|-------------------------------|--------------|------------------------------------|--------------|
|            | 成交金额                          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额                               | 占当期债券成交总额的比例 |
| 财通证券股份有限公司 | 238,152,678.96                | 100.00%      | —                                  | —            |

注：本基金合同生效日为2016年7月19日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.1.5 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2017年01月01日-2017年06月30日 |                | 上年度可比期间<br>2016年01月01日-2016年06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 |
| 财通证券股份有限公司 | 247,000,000.00                | 100.00%        | —                                  | —              |

注：1、本基金合同生效日为2016年7月19日，无上年度可比期间数据。

2、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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的净额列示。

3、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。

#### 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

| 关联方名称           | 本期<br>2017年01月01日-2017<br>年06月30日 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日-2016<br>年06月30日 |
|-----------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,200,590.35                      | —                                      |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,571,907.66                      | —                                      |

注：1、本基金合同生效日为2016年7月19日，无上年度可比期间数据。

2、基金管理费按基金前一日的资产净值乘以0.8%的管理费率来计算，具体计算方法如下：

每日应计提基金管理费=前一日该基金资产净值×年管理费率÷当年天数

基金管理费每日计提，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3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 关联方名称          | 本期<br>2017年01月01日-2017<br>年06月30日 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日-2016<br>年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 550,147.67                        | —                                      |

注：1、本基金合同生效日为2016年7月19日，无上年度可比期间数据。

2、本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

每日应计提的基金托管费=前一日该基金资产净值×年托管费率÷当年天数

基金托管费每日计提，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3个工作日内从基金资产中一次性支取。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 本期<br>2017年01月01日-2017年06月30日 |
|--------------------|-------------------------------|
|                    |                               |

|                  | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |                 |            |
|------------------|------------------|-----------------|------------|
|                  | 财通资管积极收益<br>债券A  | 财通资管积极收益<br>债券C | 合计         |
| 财通证券             | —                | 52,179.69       | 52,179.69  |
| 财通证券资产管理有<br>限公司 | —                | 603.11          | 603.11     |
| 工商银行             | —                | 684,271.94      | 684,271.94 |

注：1、本基金合同生效日为2016年7月19日，无上年度可比期间数据。

2、支付C类基金份额基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给财通证券资产管理有限公司，再由财通证券资产管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日C类基金份额基金资产净值 \* 0.40% / 当年天数。

#### 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

本基金本报告期内未发生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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目               | 本期<br>2017年01月01日-2017年06月<br>30日 |                     | 上年度可比期间<br>2016年01月01日-2016年06月<br>30日 |                     |
|------------------|-----------------------------------|---------------------|----------------------------------------|---------------------|
|                  | 财通资管积极<br>收益债券A                   | 财通资管积<br>极收益债券<br>C | 财通资管积极<br>收益债券A                        | 财通资管积<br>极收益债券<br>C |
| 期初持有的基金份额        | 9,999,900.00                      | —                   | —                                      | —                   |
| 期间申购/买入总份额       | —                                 | —                   | —                                      | —                   |
| 期间因拆分变动份额        | —                                 | —                   | —                                      | —                   |
| 减：期间赎回/卖出总<br>份额 | —                                 | —                   | —                                      | —                   |
| 期末持有的基金份额        | 9,999,900.00                      | —                   | —                                      | —                   |
| 占基金总份额比例         | 1.94%                             | —                   | —                                      | —                   |

注：本基金合同生效日为2016年7月19日，无上年度可比期间数据。

##### 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

本基金本报告期末无除基金管理人以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<br>2017年01月01日-2017年06月30<br>日 |            | 上年度可比期间<br>2016年01月01日-2016年06月30<br>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<br>活期存款 | 26,173,427.05                     | 131,434.50 | —                                      | —      |

注：1、本基金的银行存款由托管人中国工商银行保管，按同业利率计息。

2、本基金合同生效日为2016年7月19日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

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

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2017年06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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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<br>估值单<br>价 | 复牌<br>日期   | 复牌<br>开盘单<br>价 | 数量     | 期末<br>成本总<br>额 | 期末<br>估值总<br>额 |
|--------|------|------------|-----------|----------------|------------|----------------|--------|----------------|----------------|
| 000034 | 神州数码 | 2017-03-21 | 筹划重大事项    | 24.45          | 2017-07-18 | 22.01          | 58,000 | 1,192,610.20   | 1,418,100.00   |
| 300104 | 乐视网  | 2017-04-17 | 筹划重大资产重组事 | 30.68          |            |                | 46,000 | 1,509,800.00   | 1,411,280.00   |

|  |  |  |   |  |  |  |  |  |
|--|--|--|---|--|--|--|--|--|
|  |  |  | 项 |  |  |  |  |  |
|--|--|--|---|--|--|--|--|--|

注：截至本报告批准报出日，“乐视网”仍未发布复牌公告。

### 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

截至2017年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额83,999,474.00元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码    | 债券名称    | 回购到期日      | 期末估值单价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|---------|---------|------------|--------|---------|---------------|
| 1280229 | 12鑫泰债   | 2017-07-05 | 51.15  | 500,000 | 25,575,000.00 |
| 1280392 | 12芜湖新马债 | 2017-07-05 | 62.04  | 400,000 | 24,816,000.00 |
| 1280482 | 12重庆北飞债 | 2017-07-06 | 62.05  | 300,000 | 18,615,000.00 |
| 1380037 | 13长兴岛债  | 2017-07-06 | 61.88  | 200,000 | 12,376,000.00 |
| 1380325 | 13资阳水务  | 2017-07-06 | 83.85  | 50,000  | 4,192,500.00  |

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额22,999,770.00元，于2017年7月3日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 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

本基金是一只债券型基金，其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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、证券公司发行的短期公司债券）、债券回购、协议存款、通知存款、定期存款、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、国债期货以及经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）。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。本基金管理人制定了相应政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立合规风控委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

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，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，通过对投资品种和证券发行人进行信用等级评估来控制信用风险，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本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，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，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在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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独立的风险管理部门设定流

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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，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的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券部分在证券交易所上市，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，其余均能以合理价格适时变现。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投资的公允价值。

#### 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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末2017年06月30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           | 26,173,427.05 | —             | —              | —              | —              | —             | 26,173,427.05  |
| 结算备付金          | 2,838,464.49  | —             | —              | —              | —              | —             | 2,838,464.49   |
| 存出保证金          | 143,284.73    | —             | —              | —              | —              | —             | 143,284.73     |
| 交易性金融资产        | 30,100,000.00 | 55,098,500.00 | 118,380,440.80 | 212,589,460.60 | 161,652,500.00 | 18,067,180.00 | 595,888,081.40 |

|           |                |               |                |                |                |               |                |
|-----------|----------------|---------------|----------------|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 应收证券清算款   | —              | —             | —              | —              | —              |               |                |
| 应收利息      | —              | —             | —              | —              | —              | 13,773,455.21 | 13,773,455.21  |
| 应收申购款     | —              | —             | —              | —              | —              | 120,323.40    | 120,323.40     |
| 资产总计      | 59,255,176.27  | 55,098,500.00 | 118,380,440.80 | 212,589,460.60 | 161,652,500.00 | 31,960,958.61 | 638,937,036.28 |
| 负债        |                |               |                |                |                |               |                |
| 卖出回购金融资产款 | 106,999,244.00 | —             | —              | —              | —              | —             | 106,999,244.00 |
| 应付证券清算款   | —              | —             | —              | —              | —              | 9,923.41      | 9,923.41       |
| 应付赎回款     | —              | —             | —              | —              | —              | 204,958.92    | 204,958.92     |
| 应付管理人报酬   | —              | —             | —              | —              | —              | 340,045.75    | 340,045.75     |
| 应付托管费     | —              | —             | —              | —              | —              | 85,011.47     | 85,011.47      |
| 应付销售服务费   | —              | —             | —              | —              | —              | 121,532.01    | 121,532.01     |
| 应付交易费用    | —              | —             | —              | —              | —              | 110,170.71    | 110,170.71     |
| 应付利息      | —              | —             | —              | —              | —              | 25,735.47     | 25,735.47      |
| 其他负债      | —              | —             | —              | —              | —              | 197,579.72    | 197,579.72     |
| 负债总计      | 106,999,244.00 | —             | —              | —              | —              | 1,094,957.46  | 108,094,201.46 |
| 利率敏感度缺口   | -47,744,067.73 | 55,098,500.00 | 118,380,440.80 | 212,589,460.60 | 161,652,500.00 | 30,866,001.15 | 530,842,834.82 |
| 上年度末      | 1个月以           | 1-3           | 3个月            | 1-5年           | 5年以上           | 不计息           | 合计             |

| 2016年12月<br>31日 | 内              | 个月            | -1年           |                |   |               |                |
|-----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|---|---------------|----------------|
| 资产              |                |               |               |                |   |               |                |
| 银行存款            | 105,229,295.40 | —             | —             | —              | — | —             | 105,229,295.40 |
| 结算备付金           | 331,083.92     | —             | —             | —              | — | —             | 331,083.92     |
| 存出保证金           | 326,315.89     | —             | —             | —              | — | —             | 326,315.89     |
| 交易性金融资产         | —              | 49,510,000.00 | 29,961,000.00 | 181,014,923.25 | — | 35,970,554.00 | 296,456,477.25 |
| 买入返售金融资产        | 270,000,420.00 | —             | —             | —              | — | —             | 270,000,420.00 |
| 应收证券清算款         | —              | —             | —             | —              | — | 2,628,008.05  | 2,628,008.05   |
| 应收利息            | —              | —             | —             | —              | — | 7,202,900.33  | 7,202,900.33   |
| 应收申购款           | —              | —             | —             | —              | — | 93,501.98     | 93,501.98      |
| 资产总计            | 375,887,115.21 | 49,510,000.00 | 29,961,000.00 | 181,014,923.25 | — | 45,894,964.36 | 682,268,002.82 |
| 负债              |                |               |               |                |   |               |                |
| 应付赎回款           | —              | —             | —             | —              | — | 5,452,592.84  | 5,452,592.84   |
| 应付管理人报酬         | —              | —             | —             | —              | — | 493,436.88    | 493,436.88     |
| 应付托管费           | —              | —             | —             | —              | — | 134,526.85    | 134,526.85     |
| 应付销售服务费         | —              | —             | —             | —              | — | 388,982.40    | 388,982.40     |
| 应付交易费用          | —              | —             | —             | —              | — | 584,844.64    | 584,844.64     |

|         |                |               |               |                |   |               |                |
|---------|----------------|---------------|---------------|----------------|---|---------------|----------------|
| 其他负债    | —              | —             | —             | —              | — | 81,643.78     | 81,643.78      |
| 负债总计    | —              | —             | —             | —              | — | 7,136,027.39  | 7,136,027.39   |
| 利率敏感度缺口 | 375,887,115.21 | 49,510,000.00 | 29,961,000.00 | 181,014,923.25 | — | 38,758,936.97 | 675,131,975.43 |

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                     |
|----|--------------------|-----------------------------|---------------------|
| 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<br>2017年06月30日          | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|    | 市场利率下降25个基点        | 3,121,098.0700              | 914,265.4000        |
|    | 市场利率上升25个基点        | -3,076,982.0500             | -906,499.0600       |

#### 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

其他价格风险是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债券，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2017年06月30日 |              | 上年度末<br>2016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 | 18,067,180.00      | 3.40         | 35,970,554.00       | 5.33         |
| 交易性金融资       | 577,820,901.4      | 108.85       | 260,485,923.2       | 38.58        |

|               |                |        |                |       |
|---------------|----------------|--------|----------------|-------|
| 产-债券投资        | 0              |        | 5              |       |
| 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            | 595,888,081.40 | 112.25 | 296,456,477.25 | 43.91 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除“沪深300”指数以外的其他市场变量保持不变 |                             |                     |
|----|-------------------------|-----------------------------|---------------------|
| 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<br>2017年06月30日          | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|    | “沪深300”指数上升5%           | 923,395.52                  | 2,183,644.70        |
|    | “沪深300”指数下降5%           | -923,395.52                 | -2,183,644.70       |

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，股票市场指数（沪深300）价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[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》的规定：（1）金融商品持有期间（含到期）取得的非保本收益（合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益），不征收增值税；（2）纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；（3）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴

纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 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              | 18,067,180.00  | 2.83          |
|    | 其中：股票             | 18,067,180.00  | 2.83          |
| 2  | 固定收益投资            | 577,820,901.40 | 90.43         |
|    | 其中：债券             | 577,820,901.40 | 90.43         |
|    | 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      | 29,011,891.54  | 4.54          |
| 7  | 其他资产              | 14,037,063.34  | 2.20          |
| 8  | 合计                | 638,937,036.28 | 100.00        |

### 7.2 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          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —             | —             |
| B  | 采矿业              | —             | —             |
| C  | 制造业              | 10,574,833.00 | 1.99          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —             | —             |
| E  | 建筑业              | 1,461,680.00  | 0.28          |

|   |                 |               |      |
|---|-----------------|---------------|------|
| F | 批发和零售业          | 1,418,100.00  | 0.27 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 248,000.00    | 0.05 |
| H | 住宿和餐饮业          | —             | —    |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,411,280.00  | 0.27 |
| J | 金融业             | 2,953,287.00  | 0.56 |
| 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              | 18,067,180.00 | 3.40 |

### 7.2.1 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港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 600298 | 安琪酵母 | 66,900  | 1,730,703.00 | 0.33         |
| 2  | 002508 | 老板电器 | 34,600  | 1,504,408.00 | 0.28         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 62,700  | 1,499,157.00 | 0.28         |
| 4  | 002597 | 金禾实业 | 68,000  | 1,486,480.00 | 0.28         |
| 5  | 600201 | 生物股份 | 41,600  | 1,479,712.00 | 0.28         |
| 6  | 002271 | 东方雨虹 | 39,500  | 1,465,450.00 | 0.28         |
| 7  | 601668 | 中国建筑 | 151,000 | 1,461,680.00 | 0.28         |
| 8  | 600309 | 万华化学 | 51,000  | 1,460,640.00 | 0.28         |
| 9  | 600816 | 安信信托 | 107,000 | 1,454,130.00 | 0.27         |
| 10 | 601216 | 君正集团 | 296,000 | 1,447,440.00 | 0.27         |



|    |        |      |        |              |      |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
| 11 | 000034 | 神州数码 | 58,000 | 1,418,100.00 | 0.27 |
| 12 | 300104 | 乐视网  | 46,000 | 1,411,280.00 | 0.27 |
| 13 | 600350 | 山东高速 | 40,000 | 248,000.00   | 0.05 |

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## 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  | 300359 | 全通教育 | 3,579,388.66 | 0.53            |
| 2  | 300104 | 乐视网  | 3,317,300.00 | 0.49            |
| 3  | 300498 | 温氏股份 | 2,524,380.00 | 0.37            |
| 4  | 300017 | 网宿科技 | 2,374,400.00 | 0.35            |
| 5  | 601009 | 南京银行 | 2,049,000.00 | 0.30            |
| 6  | 000034 | 神州数码 | 2,015,100.00 | 0.30            |
| 7  | 002051 | 中工国际 | 2,008,000.00 | 0.30            |
| 8  | 600352 | 浙江龙盛 | 1,980,960.00 | 0.29            |
| 9  | 002589 | 瑞康医药 | 1,905,950.00 | 0.28            |
| 10 | 002456 | 欧菲光  | 1,879,489.00 | 0.28            |
| 11 | 601898 | 中煤能源 | 1,821,100.00 | 0.27            |
| 12 | 300059 | 东方财富 | 1,802,950.00 | 0.27            |
| 13 | 000960 | 锡业股份 | 1,721,740.00 | 0.26            |
| 14 | 002460 | 赣锋锂业 | 1,700,800.00 | 0.25            |
| 15 | 600298 | 安琪酵母 | 1,694,031.00 | 0.25            |
| 16 | 002035 | 华帝股份 | 1,676,520.00 | 0.25            |
| 17 | 000568 | 泸州老窖 | 1,643,689.00 | 0.24            |
| 18 | 000906 | 浙商中拓 | 1,536,311.00 | 0.23            |
| 19 | 600019 | 宝钢股份 | 1,531,800.00 | 0.23            |
| 20 | 002203 | 海亮股份 | 1,522,200.00 | 0.23            |

注：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  | 601009 | 南京银行 | 3,495,200.00 | 0.52            |
| 2  | 000906 | 浙商中拓 | 3,027,792.51 | 0.45            |
| 3  | 002241 | 歌尔股份 | 2,905,600.00 | 0.43            |
| 4  | 300359 | 全通教育 | 2,903,600.70 | 0.43            |
| 5  | 002138 | 顺络电子 | 2,818,745.00 | 0.42            |
| 6  | 600085 | 同仁堂  | 2,626,375.00 | 0.39            |
| 7  | 600661 | 新南洋  | 2,552,926.65 | 0.38            |
| 8  | 002126 | 银轮股份 | 2,386,387.00 | 0.35            |
| 9  | 000728 | 国元证券 | 2,295,558.00 | 0.34            |
| 10 | 300498 | 温氏股份 | 2,265,170.06 | 0.34            |
| 11 | 600489 | 中金黄金 | 2,151,000.00 | 0.32            |
| 12 | 002051 | 中工国际 | 2,087,500.00 | 0.31            |
| 13 | 002456 | 欧菲光  | 1,967,200.00 | 0.29            |
| 14 | 002372 | 伟星新材 | 1,964,345.00 | 0.29            |
| 15 | 300265 | 通光线缆 | 1,947,750.00 | 0.29            |
| 16 | 002589 | 瑞康医药 | 1,933,360.00 | 0.29            |
| 17 | 002044 | 美年健康 | 1,922,502.70 | 0.28            |
| 18 | 600352 | 浙江龙盛 | 1,894,827.58 | 0.28            |
| 19 | 000568 | 泸州老窖 | 1,888,000.00 | 0.28            |
| 20 | 600535 | 天士力  | 1,883,810.00 | 0.28            |

注：卖出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。

7.4.3 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

|              |               |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 76,349,962.66 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 90,398,597.50 |

注：“买入股票成本”或“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      | 29,134,540.80  | 5.49         |
| 2  | 央行票据      | —              | —            |
| 3  | 金融债券      | 49,375,000.00  | 9.30         |
|    | 其中：政策性金融债 | 49,375,000.00  | 9.30         |
| 4  | 企业债券      | 333,962,360.60 | 62.91        |
| 5  | 企业短期融资券   | 165,349,000.00 | 31.15        |
| 6  | 可转债       | —              | —            |
| 7  | 其他        | —              | —            |
| 8  | 合计        | 577,820,901.40 | 108.85       |

### 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  | 170210    | 17国开10       | 500,000 | 49,375,000.00 | 9.30         |
| 2  | 041754012 | 17鲁钢铁CP001   | 450,000 | 45,243,000.00 | 8.52         |
| 3  | 1380278   | 13克州债        | 500,000 | 40,910,000.00 | 7.71         |
| 4  | 041776001 | 17镇江新城CP001  | 400,000 | 39,868,000.00 | 7.51         |
| 5  | 011698807 | 16国电南自SCP001 | 300,000 | 30,084,000.00 | 5.67         |

### 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

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金对国债期货的投资以套期保值，回避市场风险为主要目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称                     | 持仓量(买/卖) | 合约市值<br>(元)      | 公允价值变<br>动(元) | 风险指标说明      |
|-------------------|------------------------|----------|------------------|---------------|-------------|
| T1709             | 10年期国债<br>期<br>货1709合约 | 3        | 2,857,200.<br>00 | -7,050.00     | 套保          |
| 公允价值变动总额合计(元)     |                        |          |                  |               | -7,050.00   |
| 国债期货投资本期收益(元)     |                        |          |                  |               | -387,850.00 |
| 国债期货投资本期公允价值变动(元) |                        |          |                  |               | -7,050.00   |

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

报告期内国债期货的操作符合相关投资政策，并且达到了套期保值的效果。

## 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未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

7.12.2 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   | 143,284.73    |
| 2  | 应收证券清算款 | —             |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | 13,773,455.21 |
| 5  | 应收申购款   | 120,323.40    |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | —             |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 14,037,063.34 |

### 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

| 份额<br>级别                | 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构             |                |                    |                |
|-------------------------|--------------|---------------|-------------------|----------------|--------------------|----------------|
|                         |              |               | 机构投资者             |                | 个人投资者              |                |
|                         |              |               | 持有<br>份额          | 占总份<br>额<br>比例 | 持有<br>份额           | 占总份<br>额<br>比例 |
| 财通资<br>管积极<br>收益债<br>券A | 748          | 190,650.16    | 10,000,883<br>.46 | 7.01%          | 132,605,43<br>6.63 | 92.99%         |
| 财通资<br>管积极              | 741          | 502,731.91    | —                 | —              | 372,524,34<br>3.00 | 100.00%        |

|       |       |            |               |       |                |        |
|-------|-------|------------|---------------|-------|----------------|--------|
| 收益债券C |       |            |               |       |                |        |
| 合计    | 1,489 | 345,957.46 | 10,000,883.46 | 1.94% | 505,129,779.63 | 98.06% |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目                  | 份额级别        | 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开放式基金 | 财通资管积极收益债券A | 1,964.11  | 0.00%    |
|                     | 财通资管积极收益债券C | 1,980.84  | 0.00%    |
|                     | 合计          | 3,944.95  | 0.00%    |

## 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

- 1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、期末本基金的基金经理未持有本基金。

## 8.4 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   | 9,999,900.00 | 1.94%        | 9,999,900.00 | 1.94%        | 自合同生效之日起不少于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          | 9,999,900.   | 1.94%        | 9,999,900.   | 1.94%        | 自合同生效         |

|  |    |  |    |  |          |
|--|----|--|----|--|----------|
|  | 00 |  | 00 |  | 之日起不少于3年 |
|--|----|--|----|--|----------|

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            | 财通资管积极收益债券A    | 财通资管积极收益债券C    |
|----------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日(2016年07月19日)基金份额总额 | 359,722,982.26 | 982,996,998.17 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 226,015,684.24 | 441,556,604.00 |
| 本报告期基金总申购份额                | 19,628,379.94  | 77,642,382.75  |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 103,037,744.09 | 146,674,643.75 |
| 本报告期基金拆分变动份额               | —              | —              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 142,606,320.09 | 372,524,343.00 |

### § 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，本基金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

本报告期内，无基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

#### 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，公司作为被告收到天津市和平区人民法院于2017年4月27日出具的传票，原告为汉华易美（天津）图像技术有限公司，起诉事由为公司公众号未经授权使用其拥有著作权的图片侵害其信息网络传播权，索赔金额为33000元。目前案件尚在审理过程中。本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

#### 10.5 基金改聘会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内,本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

### 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位:

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |           | 债券交易           |           | 债券回购交易         |             | 权证交易 |           | 应支付该券商的佣金 |            | 备注   |
|------|--------|----------------|-----------|----------------|-----------|----------------|-------------|------|-----------|-----------|------------|------|
|      |        | 成交金额           | 占股票成交总额比例 | 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 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |      |
| 财通证券 | 2      | 113,132,207.19 | 67.85%    | 238,152,678.96 | 100.00%   | 247,000,000.00 | 100.00%     | —    | —         | 82,851.48 | 67.88%     |      |
| 国金证券 | 1      | 53,614,572.97  | 32.15%    | —              | —         | —              | —           | —    | —         | 39,208.08 | 32.12%     | 本期新增 |
| 兴业期货 | 0      | —              | —         | —              | —         | —              | —           | —    | —         | —         | —          | —    |
| 永安期货 | 0      | —              | —         | —              | —         | —              | —           | —    | —         | —         | —          | —    |
| 招商期货 | 0      | —              | —         | —              | —         | —              | —           | —    | —         | —         | —          | —    |

注:本基金管理人负责选择证券经营机构,租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金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,在业内有良好的声誉;
- 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，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；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。基金交易单元的选择程序如下：

- 1、本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2、基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                            | 信息披露方式                                       | 披露日期       |
|----|-------------------------------------------------|----------------------------------------------|------------|
| 1  | 财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金年末净值公告<br>(20161231净值)      | 中国证券报、上海证券报、<br>证券时报、管理人网站<br>(www.ctzg.com) | 2017-01-01 |
| 2  | 财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金2016年第4季度报告                 | 同上                                           | 2017-01-21 |
| 3  | 关于旗下部分基金在财通证券股份有限公司新增定期定额投资业务的公告                | 同上                                           | 2017-02-13 |
| 4  | 关于财通证券资产管理有限公司旗下基金增加上海陆金所资产管理有限公司等公司为代销机构的公告    | 同上                                           | 2017-02-21 |
| 5  | 财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金招募说明书(更新)<br>(2017年第1号)     | 同上                                           | 2017-03-03 |
| 6  | 财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金招募说明书(更新)<br>(摘要)(2017年第1号) | 同上                                           | 2017-03-03 |
| 7  | 财通证券资产管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔申购最低金额限制的公告             | 同上                                           | 2017-03-08 |
| 8  | 财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金2016年年度报告摘                  | 同上                                           | 2017-03-27 |

|    | 要                                               |    |            |
|----|-------------------------------------------------|----|------------|
| 9  | 财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金2016年年度报告                   | 同上 | 2017-03-27 |
| 10 | 财通证券资产管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告 | 同上 | 2017-03-31 |
| 11 | 财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金2017年第1季度报告                 | 同上 | 2017-04-22 |
| 12 | 关于调整财通资管积极收益债券型基金交易所固定收益品种估值方法的公告               | 同上 | 2017-05-25 |
| 13 | 财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金暂停大额申购业务公告                  | 同上 | 2017-06-13 |

### § 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

| 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   |
| 个人    | 1              | 2017年1月1日至2017年6月30日   | 200,027,000.00 | —    | —    | 200,027,000.00 | 38.83% |

#### 产品特有风险

本基金本报告期出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对本基金造成流动性风险，从而影响基金的投资运作和收益水平。管理人将在基金运作中加强流动性管理，保持合适的流动性水平，对申购赎回进行合理的应对，防范流动性风险，保障持有人利益。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金相关批准文件
- 2、财通证券资产管理有限公司营业执照、公司章程
- 3、财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金基金合同
- 4、财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区福山路500号城建国际大厦28楼  
浙江省杭州市上城区四宜路四宜大院B幢办公楼

### 12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人财通证券资产管理有限公司。

咨询电话：95336

公司网址：[www.ctzg.com](http://www.ctzg.com)

财通证券资产管理有限公司  
二〇一七年八月二十四日