

财通收益增强债券型证券投资基金(原“财通保本混合型发起式证券投资基金”)
2015年第4季度报告

2015年12月31日

基金管理人：财通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2016年1月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。本报告中财务资料未经审计。

财通保本混合型发起式证券投资基金于2015年12月25日转型为财通收益增强债券型证券投资基金，同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容根据基金合同的相关约定进行相应修改。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。其中原财通保本混合型发起式证券投资基金报告期自2015年10月1日至12月24日(第一个保本周期到期日为2015年12月21日，到期操作期间为2015年12月21日至2015年12月24日)，财通收益增强债券型证券投资基金报告期自2015年12月25日至2015年12月31日。

§2 基金产品概况

2.1 财通收益增强债券型证券投资基金（转型后）

基金简称	财通收益增强债券
场内简称	-
基金主代码	720003
交易代码	-
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2012年12月20日
报告期末基金份额总额	116,496,963.34份
投资目标	在保持资产流动性和严格控制风险的基础上，综合利用多种投资策略，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金长期战略性资产配置以债券为主。同时，在不同的市场条件下，本基金将综合考虑宏观环境、公司基本面、市场估值水平以及投资者情绪，在一定的范

	<p>围内对债券、股票和现金各自的投资比例作战术性资产配置调整，以降低系统性风险对基金收益的影响。</p> <p>债券资产投资策略层面，本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资，主要投资策略包括债券投资组合策略和动态品种优化策略；股票投资策略层面，本基金以价值投资为基本投资理念，结合定性分析与定量分析的结果，以价值选股、组合投资为原则，选择具备估值吸引力、增长潜力显著的公司股票构建本基金的股票投资组合；本基金在权证投资方面主要运用的策略包括价值发现策略和套利交易策略等；如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他衍生金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金对衍生金融工具的投资主要以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。</p>
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和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。
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

2.2 财通保本混合型发起式证券投资基金（转型前）

基金简称	财通保本混合发起
场内简称	-
基金主代码	720003
交易代码	-
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2012年12月20日
报告期末(2015年12月21日)基金份额总额	170,080,550.21份
投资目标	通过灵活运用投资组合保险策略，在保障本金安全的前提下，力争在保本周期内实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金将各类金融工具划分为安全资产和风险资产，

	其中债券（可转换债券除外）及货币市场工具等属于安全资产，可转换债券、股票、权证等资产属于风险资产。本基金的投资策略分为两个层面：第一个层面，根据固定比例投资组合保险策略（CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance）和时间不变性投资组合保险策略（TIPP, Time Invariant Portfolio Protection），动态调整安全资产与风险资产的投资比例，即资产配置策略；第二个层面，分别针对安全资产和风险资产的投资策略。
业绩比较基准	每个保本周期开始日（在第一个保本周期内为基金成立日）中国人民银行确定的三年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金为保本混合型产品，属证券投资基金中的低风险收益品种。
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
基金保证人	中海信达担保有限公司

注：根据北京市金融工作局发布的《关于撤销中海信达担保有限公司融资性担保公司经营许可证的公告》，中海信达担保有限公司《融资性担保公司经营许可证》被撤销，不得开展新的融资性担保业务，之前开展的融资性担保业务应依照相关法律法规继续履行担保责任。根据本基金合同的规定，担保人对本公司的保本偿付义务承担连带保证责任。根据本基金目前的运作状况，其发生保本偿付事件的机率较低，且基金管理人完全有能力履行相关义务，保障投资人正当权益不受损害，担保人被撤销担保资格应不会对基金份额持有人的利益造成实质负面影响。公司已就相关情况向监管机构以及投资人履行了报告和披露的义务。截至报告日，本基金保本周期已到期，未发生保本偿付事件，担保人的担保义务已终止，本基金已顺利转型为“财通收益增强债券型证券投资基金”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期	报告期
	转型后（2015年12月25日-2015年12月31日）	转型前（2015年10月1日-2015年12月24日）

1.本期已实现收益	21,231.10	6,049,820.06
2.本期利润	-142,966.09	576,012.18
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0012	0.0049
4.期末基金资产净值	145,716,103.63	151,405,172.53
5.期末基金份额净值	1.251	1.252

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)本基金转型到期操作期间为2015年12月21日至2015年12月24日，于2015年12月25日正式转型为财通收益增强债券型证券投资基金。

3.2 财通收益增强债券基金净值表现(转型后)

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

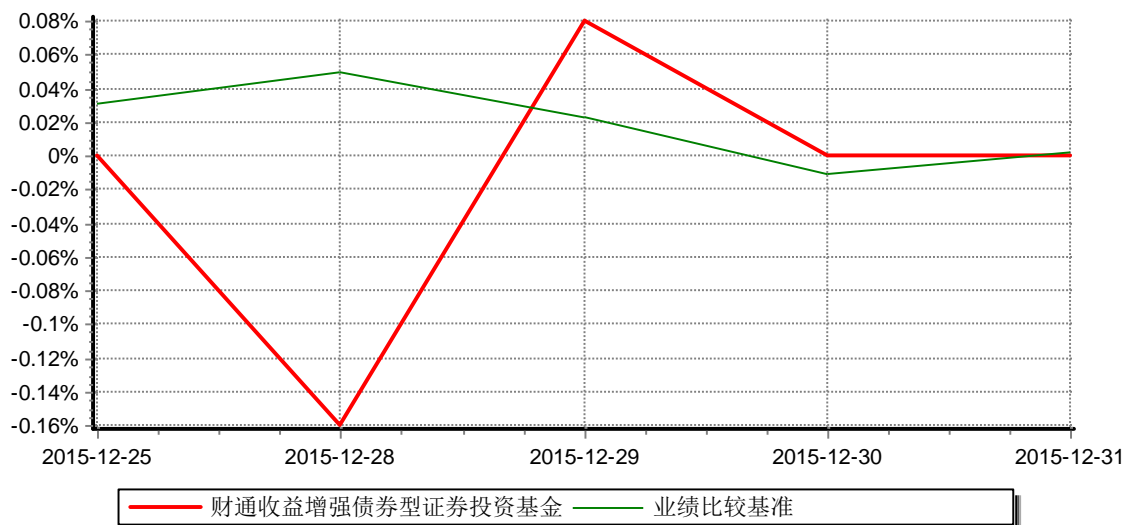
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.08%	0.09%	0.10%	0.02%	-0.18%	0.07%

注：(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

(2)本基金业绩比较基准为：中债综合指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

财通收益增强债券型证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2015年12月25日-2015年12月31日)



注：(1)本基金合同生效日为2012年12月20日，根据合同规定，第一个保本周期到期日为2015年12月21日，本基金于2015年12月25日转型为非保本的债券型证券投资基金，基金转型日至披露时点未满一年；

(2)本基金转型为非保本的债券型证券投资基金后，股票、权证等权益类占基金资产： $\leq 20\%$ ；债券等固定收益类资产占基金资产： $\geq 80\%$ ；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值： $\geq 5\%$ ；权证占基金资产净值： $\leq 3\%$ 。本基金的建仓期为2015年12月25日至2016年6月25日，截至报告日，本基金尚在建仓期，基金的资产配置将在建仓期结束前符合基金契约的相关要求。

3.2 财通保本混合发起基金净值表现(转型前)

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
报告期（2015年10月1日至2015年12月24日）	0.40%	0.74%	1.01%	0.01%	-0.61%	0.73%

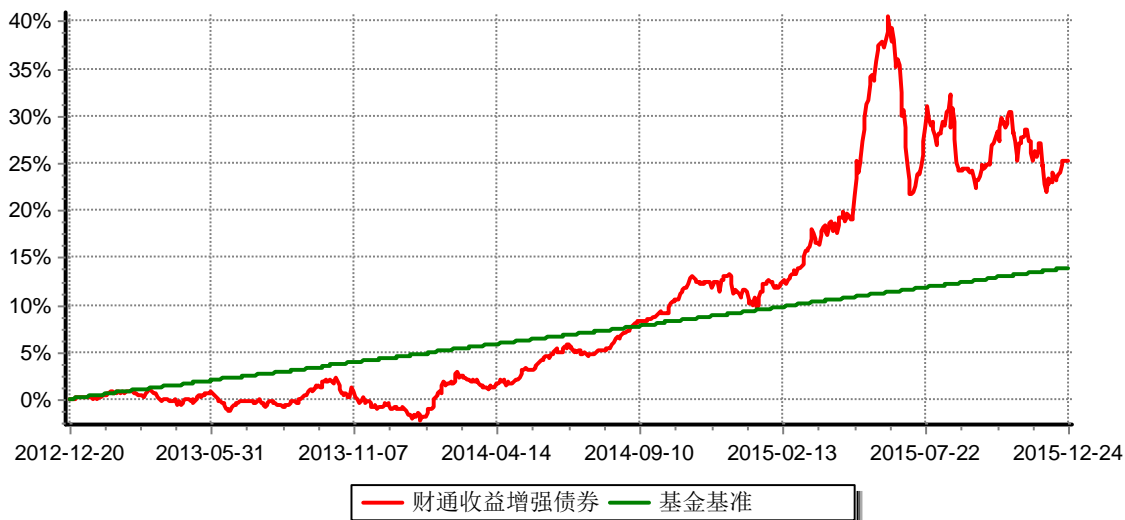
注：(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

(2)本基金业绩比较基准为：每个保本周期开始日（在第一个保本周期内为基金成立日）中国人民银行确定的三年期银行定期存款税后收益率；

(3)根据基金合同规定，本基金于2015年12月25日转型为非保本的债券型证券投资基金，业绩比较基准相应变更为中债综合指数收益率。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

财通保本混合型发起式证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2012年12月20日-2015年12月24日)



注：(1)本基金合同生效日为2012年12月20日，根据合同规定，第一个保本周期到期日为2015年12月21日，本基金于2015年12月25日转型为非保本的债券型证券投资基金。

(2)本基金在第一个保本周期内，股票、权证等权益类占基金资产： $\leq 40\%$ ；债券、货币市场工具、现金及其他资产占基金资产： $\geq 60\%$ ；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值： $\geq 5\%$ ；权证占基金资产净值： $\leq 3\%$ 。本基金的建仓期为2012年12月20日至2013年6月20日，截至建仓期末及本报告期末，基金的资产配置符合基金契约的相关要求。其中，本基金到期操作期间为2015年12月21日至2015年12月24日，该期间内，除暂时无法变现的基金财产外，基金财产根据基金合同的规定保持为现金。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
焦庆	本基金的基金经理	2014年11月24日	—	8年	哈尔滨工业大学管理学博士。历任深圳飞亚达集团华东区域经理、市场部副总经理，西部证券资产管

					理部研究员，天治基金高级研究员，上海泽熙投资高级研究员。历任财通基金管理有限公司研究部总监助理、副总监、投资经理。
张亦博	本基金的基金经理	2015年8月27日	—	6年	澳大利亚莫纳什大学风险管理学硕士，特许金融分析师（CFA）。历任德邦证券有限责任公司研究所研究员，东吴证券股份有限公司资产管理总部债券研究员、债券投资经理助理，华宝证券有限责任公司资产管理部固定收益投资经理。2015年8月加入财通基金管理有限公司。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

同时，公司逐步建立健全公司各投资组合均可参考的投资对象备选库和交易对手备选库，在此平台上共享研究成果，并对各组合提供无倾向性支持；在公用备选库的基础上，各投资组合经理根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限

制等，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库，进而根据投资授权构建具体的投资组合。在确保投资组合间信息隔离、权限明晰的基础上，形成信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合及短期国债回购交易除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

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

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本报告期内，基金管理人通过扎实的宏观、货币政策研究和对行业以及公司的信用分析，在较高的安全边际条件下，积极参与市场利率下行、资金面宽松等变化带来的债券类资产的交易性机会，主要关注和把握中长端利率的机会，并适当提高杠杆。在资产配置方面采用资质良好的中高信用等级信用债和收益率较高且估值稳定的PPN、非公开公司债作为配置底仓以获得较为稳定的持有期收益，同时通过个券调研、深入分析精选资质较好、性价比较高的高收益信用债获得个券投资的超额收益，同时采取套息交易策略以规避信用风险；配合流动性较好的利率债进行波段操作获取资本利得增强组合收益。

本基金管理人一直保持稳健的投资风格，始终将风险评估放在首位，通过充分分散组合的资产，达到尽量消除非系统性风险的目的。通过积极、主动的组合管理，挖掘市场机会，以期获得超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止到2015年12月31日,本基金单位净值为1.251元,本基金的累计单位净值为1.251元。转型前本基金净值增长率为0.40%,业绩比较基准收益率为1.01%,低于业绩比较基准61bp。转型后,本基金尚处于建仓期。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济持续下行,电力耗煤跌幅持续扩大,工业生产仍无起色。大宗商品价格继续大幅下滑,大宗商品价格探底对2016年经济带来较大的影响,经济仍面临一定的通缩风险。人民币加入SDR后持续贬值,资金流出压力加大,央行通过公开市场操作、设定利率走廊上限等工具来稳定流动性预期,货币宽松格局未改变。同时,为配合供给侧改革,预计政策依然宽松,积极的财政政策将加大力度,货币政策更加灵活适度,资金面整体宽松,双松政策组合将对冲去产能、去库存、去杠杆对经济的冲击,提高企业应对经济冲击的能力。在经济下行压力较大整体宏观条件下,中国经济正处于转型阶段,经济仍将低位平稳运行,央行或将保持货币政策的连续性和稳定性,继续实施适度宽松的货币政策,维持市场流动性松紧适度,货币市场利率低位稳定。

§5 投资组合报告

(一) 财通收益增强债券(转型后)

5.1 报告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	8,750,000.00	5.96
	其中:股票	8,750,000.00	5.96
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	30,926,898.40	21.07
	其中:债券	30,926,898.40	21.07
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—

5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	95,000,000.00	64.72
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	11,168,136.96	7.61
8	其他资产	948,771.36	0.65
9	合计	146,793,806.72	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	8,750,000.00	6.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
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	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	8,750,000.00	6.00

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600699	均胜电子	280,000	8,750,000.00	6.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	21,015,898.40	14.42
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	9,911,000.00	6.80
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	30,926,898.40	21.22

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	124832	14睢宁润	100,000	10,594,000.00	7.27
2	124334	13博国资	100,000	10,260,000.00	7.04
3	1282324	12义马MTN1	100,000	9,911,000.00	6.80
4	124289	13丽城投	1,570	161,898.40	0.11

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金不投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或

在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	243,019.39
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	705,751.97
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	948,771.36

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600699	均胜电子	8,750,000.00	6.00	重大事项停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

(二) 财通保本混合发起（转型前）

5.12 报告期末（2015年12月24日）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	8,750,000.00	5.40
	其中：股票	8,750,000.00	5.40

2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	10,090,678.60	6.23
	其中：债券	10,090,678.60	6.23
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	142,720,834.32	88.13
8	其他资产	386,498.86	0.24
9	合计	161,948,011.78	100.00

5.13 报告期末（2015年12月24日）按行业分类的股票投资组合

5.13.1 报告期末（2015年12月24日）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	8,750,000.00	5.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
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	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	8,750,000.00	5.78

5.13.2 报告期末（2015年12月24日）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。

5.14 报告期末（2015年12月24日）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600699	均胜电子	280,000	8,750,000.00	5.78

5.15 报告期末（2015年12月24日）按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	161,678.60	0.11
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	9,929,000.00	6.56
7	可转债（可交换债）	—	—

8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	10,090,678.60	6.66

5.16 报告期末（2015年12月24日）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1282324	12义马MTN1	100,000	9,929,000.00	6.56
2	124289	13丽城投	1,570	161,678.60	0.11

5.17 报告期末（2015年12月24日）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.18 报告期末（2015年12月24日）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.19 报告期末（2015年12月24日）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.20 报告期末（2015年12月24日）本基金投资的股指期货交易情况说明

5.20.1 报告期末（2015年12月24日）本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.20.2 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。

5.21 报告期末（2015年12月24日）本基金投资的国债期货交易情况说明

5.21.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

5.21.2 报告期末（2015年12月24日）本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.21.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.22 投资组合报告附注

5.22.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.22.2 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.22.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	243,019.39
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	143,479.47
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	386,498.86

5.22.4 报告期末（2015年12月24日）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。

5.22.5 报告期末（2015年12月24日）前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600699	均胜电子	8,750,000.00	5.78	重大事项停牌

5.22.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	121,897,216.21
报告期期间基金总申购份额	68,857,884.28
减：报告期期间基金总赎回份额	74,258,137.15
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
报告期期末基金份额总额	116,496,963.34

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

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

1、2015年10月10日披露了《财通基金管理有限公司关于北京分公司办公地址变更的公告》；

2、2015年10月23日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告》；

3、2015年10月23日披露了《关于财通基金管理有限公司增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司为代销机构并针对部分基金开展申购费率优惠活动的公告》；

4、2015年10月26日披露了《财通保本混合型发起式证券投资基金2015年第3季度报告》；

5、2015年11月2日披露了《关于财通基金管理有限公司增加上海凯石财富基金销售有限公司为代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告》；

6、2015年11月2日披露了《关于财通基金管理有限公司增加珠海盈米财富管理有限

公司为代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告》；

7、2015年11月11日披露了《财通基金管理有限公司关于提请投资者完善个人信息的公告》；

8、2015年11月11日披露了《关于财通基金管理有限公司增加大泰金石投资管理有限公司为代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告》；

9、2015年11月17日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下资产管理计划投资长江精工钢结构（集团）股份有限公司股份情况的公告》；

10、2015年11月21日披露了《关于提请投资人关注网银及个人信息安全，防止网银及个人信息被不法分子盗用，损害投资人权益的公告》；

11、2015年11月21日披露了《关于财通保本混合型发起式证券投资基金保本周期到期第一次提示公告》；

12、2015年11月28日披露了《关于财通保本混合型发起式证券投资基金保本周期到期第二次提示公告》；

13、2015年12月5日披露了《关于财通保本混合型发起式证券投资基金保本周期到期第三次提示公告》；

14、2015年12月5日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下资产管理计划投资北京翠微大厦股份有限公司股份情况的公告》；

15、2015年12月5日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下资产管理计划投资重庆市迪马实业股份有限公司股份情况的公告》；

16、2015年12月7日披露了《关于财通基金管理有限公司增加北京恒天明泽基金销售有限公司为代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告》；

17、2015年12月7日披露了《关于财通基金管理有限公司增加嘉实财富管理有限公司为代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告》；

18、2015年12月16日披露了《关于财通保本混合型发起式证券投资基金保本周期到期的公告》；

19、2015年12月16日披露了《关于财通保本混合型发起式证券投资基金转型期间暂停申购（转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资）业务公告》；

20、2015年12月16日披露了《关于财通基金管理有限公司增加恒泰证券股份有限公司为代销机构的公告》；

21、2015年12月18日披露了《关于财通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与深圳众禄金融控股股份有限公司申购费率优惠活动的公告》；

22、2015年12月19日披露了《关于财通保本混合型发起式证券投资基金保本周期到期的公告》；

23、2015年12月22日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下资产管理计划投资重

庆港九股份有限公司股份情况的公告》；

24、2015年12月22日披露了《关于财通保本混合型发起式证券投资基金保本周期届满转型的公告》；

25、2015年12月31日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下基金开放时间调整的公告》；

26、2015年12月31日披露了《关于财通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与中国农业银行申购费率优惠活动的公告》；

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

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心41楼。

9.3 查阅方式

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：<http://www.ctfund.com>。

财通基金管理有限公司
二〇一六年一月二十日