

**财通纯债债券型证券投资基金(原财通纯债分级债券型证券投资基金转型)**  
**2016年第1季度报告**

**2016年3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4月22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4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。

财通纯债分级债券型证券投资基金分级运作期届满日为2016年1月18日，根据法律法规及业务规则要求，在满足基金合同约定的存续条件下，本基金于2016年1月19日转换为不分级的开放式债券型基金，基金名称变更为“财通纯债债券型证券投资基金”。同时，基金的投资目标、投资范围、投资管理程序等保持不变。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。其中原财通纯债分级债券型证券投资基金报告期自2016年1月1日至1月18日，财通纯债债券型证券投资基金报告期自2016年1月19日至2016年3月31日。

## §2 基金产品概况

### 2.1 财通纯债债券型证券投资基金（转型后）

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 财通纯债债券  |
| 场内简称       | -   |
| 基金主代码      | 000497  |
| 交易代码       | -   |
| 基金运作方式     | 契约型、开放式   |
| 基金转型生效日    | 2016年1月19日  |
| 报告期末基金份额总额 | 100,466,798.08份   |
| 投资目标       | 在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争持续稳定地实现超越业绩比较基准的组合收益。 |
| 投资策略       | 本基金通过对宏观经济增长、通货膨胀、利率走势和货币政                                      |

|        |   |
|--------|---|
|        | 策四个方面的分析和预测,确定经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响。注重组合的流动性,在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上,自上而下确定大类债券资产配置和信用债券类属配置,动态调整组合久期和信用债券的结构,依然坚持自下而上精选个券的策略,在获取持有期收益的基础上,优化组合的流动性。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合(全价)指数收益率。  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,属于证券投资基金中预期收益和预期风险较低的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,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 财通纯债分级债券型证券投资基金(转型前)

|                        |  |
|------------------------|--|
| 基金简称                   | 财通纯债分级债券   |
| 场内简称                   | -  |
| 基金主代码                  | 000497   |
| 交易代码                   | -  |
| 基金运作方式                 | 契约型,本基金分级运作期内,纯债A自基金合同生效之日起每满3个月开放一次(纯债A第八次开放时,只开放赎回,不开放申购),纯债B封闭运作,且不上市交易。  |
| 基金合同生效日                | 2014年1月17日   |
| 报告期末(2016年1月18日)基金份额总额 | 104,588,639.11份  |
| 投资目标                   | 在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争持续稳定地实现超越业绩比较基准的组合收益。  |
| 投资策略                   | 本基金通过对宏观经济增长、通货膨胀、利率走势和货币政策四个方面的分析和预测,确定经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响。在封闭期内,主要以久期匹配、精选个券、适度分散、买入持有等为基本投资策略,获取长期、稳定的收益;辅以杠杆操作,资产支持证券 |

|                 |  |                      |
|-----------------|--|----------------------|
|                 | 等其他资产的投资为增强投资策略,力争为投资者获取超额收益。分级运作期结束后,将更加注重组合的流动性,将在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上,自上而下确定大类债券资产配置和信用债券类属配置,动态调整组合久期和信用债券的结构,依然坚持自下而上精选个券的策略,在获取持有期收益的基础上,优化组合的流动性。 |                      |
| 业绩比较基准          | 中债综合(全价)指数收益率。   |                      |
| 风险收益特征          | 本基金为债券型基金,属于证券投资基金中预期收益和预期风险较低的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。<br>本基金经过基金份额分级后,纯债A具有低风险、收益相对稳定的特征;纯债B具有较高风险、较高预期收益的特征。   |                      |
| 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   |                      |
| 下属两级基金的基金简称     | 财通纯债分级债券A  | 财通纯债分级债券B            |
| 下属分级基金的场内简称     | -  | -                    |
| 下属两级基金的交易代码     | 000498   | 000499               |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 16,705,490.42份   | 87,883,148.69份       |
| 下属分级基金的风险收益特征   | 纯债A具有低风险、收益相对稳定的特征。  | 纯债B具有较高风险、较高预期收益的特征。 |

注;折算基准日(2016年1月18日)日终,财通纯债分级债券A(“纯债A”)、财通纯债分级债券B(“纯债B”)的基金份额净值调整为1.000元,根据本基金《基金合同》规定的折算规则,折算后,基金份额持有人持有的纯债A、纯债B的份额数按照折算比例相应增减,其中纯债A、纯债B份额经折算后的份额数保留到小数点后两位,小数点两位以后的部分舍去,舍去部分所代表的资产归基金所有。详见基金管理人发布的相关公告。

### §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         | 转型后<br>报告期（2016年1月19日<br>-2016年3月31日） | 转型前<br>报告期（2016年1月1日<br>-2016年1月18日） |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------|
| 1.本期已实现收益      | 1,551,848.48                          | 181,330.72                           |
| 2.本期利润         | 1,313,392.32                          | 521,285.00                           |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0129                                | 0.0064                               |
| 4.期末基金资产净值     | 101,785,806.10                        | 104,588,639.11                       |
| 5.期末基金份额净值     | 1.013                                 | 1.000                                |

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)本基金分级运作期满日为2016年1月18日，于2016年1月19日正式转型为财通纯债债券型证券投资基金；

(4)本基金分级运作期满日日终，基金份额净值调整为1.000元，基金份额持有人持有的纯债A、纯债B的份额数按照折算比例相应增减，详见基金管理人发布的相关公告。

### 3.2 财通纯债债券基金净值表现（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   |
|----------------------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 报告期（2016年1月19日至2016年3月31日） | 1.29%  | 0.07%     | -0.03%     | 0.06%         | 1.32% | 0.01% |

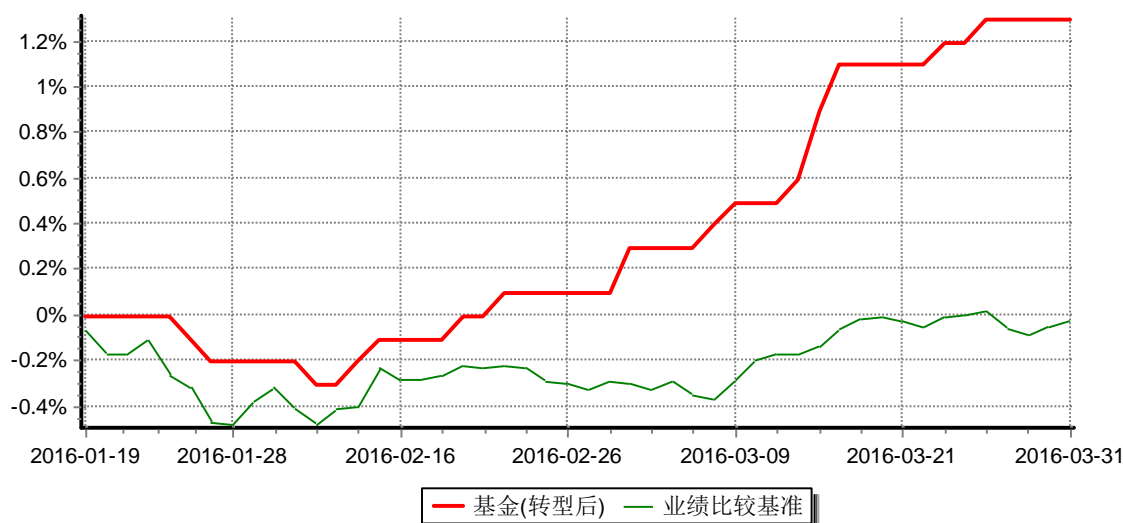
注：(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

(2)本基金业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率。

#### 3.2.2 自基金转型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

财通纯债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  
(2016年1月19日-2016年3月31日)



注：(1)本基金合同生效日为2014年1月17日，根据基金合同规定，本基金分级运作期届满日为2016年1月18日，本基金于2016年1月19日转型为不分级的开放式债券型基金，基金名称变更为“财通纯债债券型证券投资基金”，基金转型日至披露时点未满一年；

(2)在本基金转换为不分级的开放式债券型基金后，本基金的投资组合比例为：债券资产的比例不低于基金资产的80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为2014年1月17日至2014年7月17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。

### 3.2 财通纯债分级债券基金净值表现（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

##### 财通纯债分级债券A

| 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（2016年1月1日至2016年1月18日） | 0.26%  | 0.04%     | 0.34%      | 0.10%         | -0.08% | -0.06% |

##### 财通纯债分级债券B

| 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(2016年1月1日至2016年1月18日) | 0.52%  | 0.05%     | 0.34%      | 0.10%         | 0.18% | -0.05% |

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；

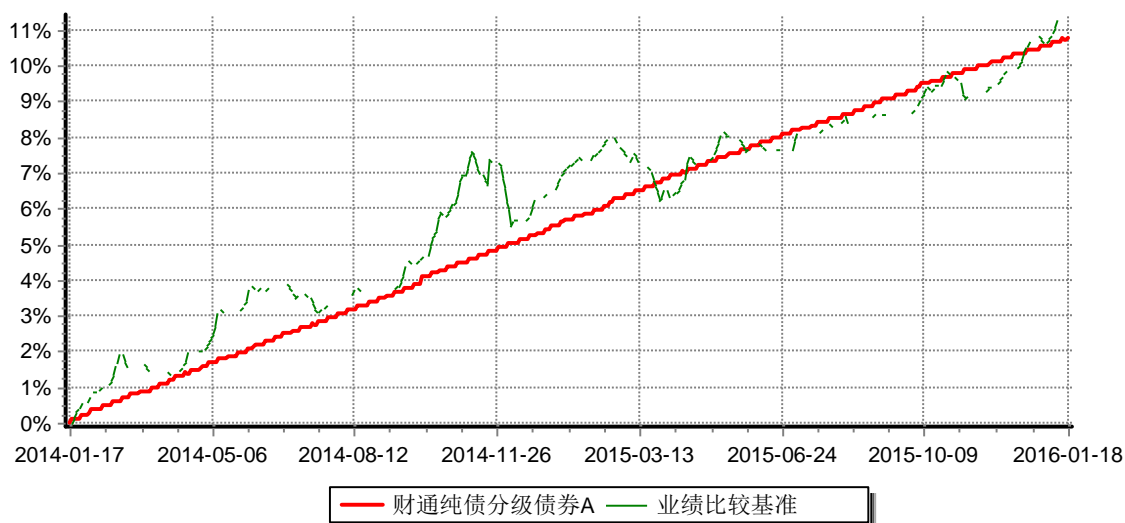
(2)本基金业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率；

(3)根据基金合同规定，本基金分级运作届满日为2016年1月18日，于2015年1月19日转型为不分级的开放式债券型基金。

### 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

#### 财通纯债分级债券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  
(2014年1月17日-2016年1月18日)

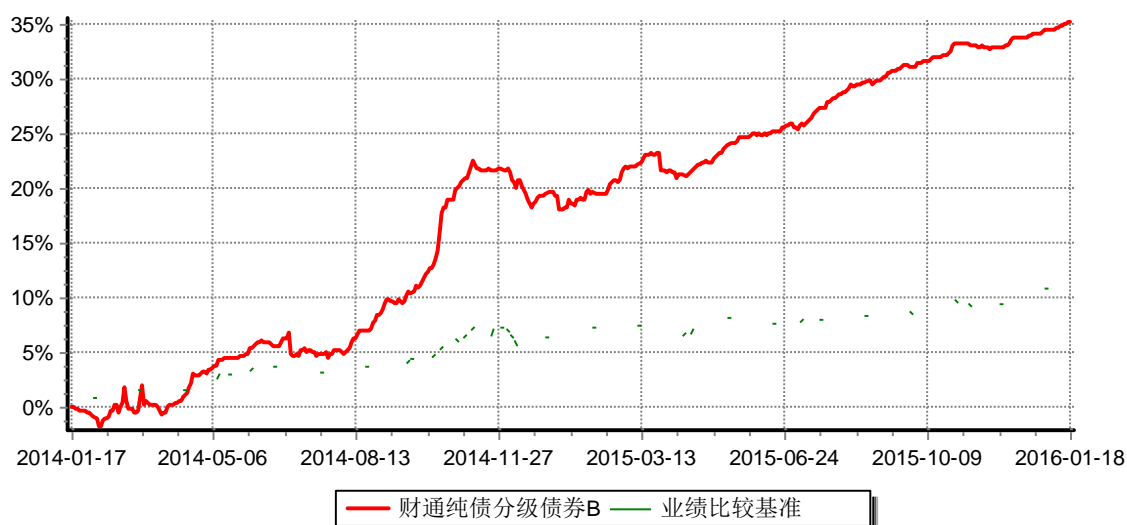


注：(1)本基金合同生效日为2014年1月17日，根据合同规定，分级运作期届满日为2016年1月18日，本基金于2016年1月19日转型为不分级的开放式债券型基金；

(2)在本基金的分级运作期内，本基金投资于债券的资产占基金资产： $\geq 80\%$ ，但在本基金A份额的每个开放日的前后各10个工作日内不受前述投资组合比例的限制；本基金不直接从二级市场买入股票、权证、可转换债券等，也不参与一级市场的新股、可转债申购或增发新股；本基金在分级运作期

内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在纯债A份额的每个开放日本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的建仓期为2014年1月17日至2014年7月17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。

财通纯债分级债券B  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2014年1月17日-2016年1月18日)



注：(1)本基金合同生效日为2014年1月17日，根据合同规定，分级运作期届满日为2016年1月18日，本基金于2016年1月19日转型为不分级的开放式债券型基金；

(2)在本基金的分级运作期内，本基金投资于债券的资产占基金资产： $\geq 80\%$ ，但在本基金A份额的每个开放日的前后各10个工作日内不受前述投资组合比例的限制；本基金不直接从二级市场买入股票、权证、可转换债券等，也不参与一级市场的新股、可转债申购或增发新股；本基金在分级运作期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在纯债A份额的每个开放日本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的建仓期为2014年1月17日至2014年7月17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。

## §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 |        |           |
| 张亦博 | 本基金的基 | 2015年08月    | -    | 6年     | 澳大利亚莫纳什大学 |



|  |     |     |  |  |   |
|--|-----|-----|--|--|---|
|  | 金经理 | 27日 |  |  | 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需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

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

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

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，本基金整体贯彻了稳健的投资策略。在杠杆运用上，由于市场担忧限制银行委外和债券杠杆进而进入调整期，本基金适度降低杠杆水平，平均杠杆比例保持在20%左右。在久期策略上，始终保持相对适中的久期水平，既保证了组合的进攻性，同时也在市场调整期间，也可以及时降低组合久期，保证组合的净值回撤幅度在可控范围之内。在券种选择方面，以2012年-2014年发行的企业债为主，同时配置了一部分交易所公司债，以提高基金收益。同时根据对宏观经济前景、资金价格水平、期限利差等因素的判断，择机投资长久期的利率债，为组合贡献资本利得回报。

#### 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1.013元，本基金的累计单位净值为1.013元。转型后本基金净值增长率为1.29%。同期业绩比较基准收益率为-0.03%。

#### 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

2016年以来, 受益于地产和基建投资拉动, 经济表现好于预期, 但发电耗煤增速逐旬下降, 经济改善持续性仍需观察。大宗商品与猪肉价格回升, 蔬菜价格反季节性上涨, 通胀预期升温。美联储重申鸽派立场, 美国近期加息隐忧基本消除, 人民币贬值压力缓解。央行推出MPA的考核模式, 同时依旧通过公开市场操作、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。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) 转型后: 财通纯债债券型证券投资基金

#### 报告期(2016年1月19日-2016年3月31日) 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             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资               | —              | —             |
|    | 其中: 股票             | —              | —             |
| 2  | 基金投资               | —              | —             |
| 3  | 固定收益投资             | 108,190,712.44 | 92.25         |
|    | 其中: 债券             | 108,190,712.44 | 92.25         |
|    | 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       | 5,090,486.67   | 4.34          |

|   |      |                |        |
|---|------|----------------|--------|
| 8 | 其他资产 | 3,995,184.56   | 3.41   |
| 9 | 合计   | 117,276,383.67 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 报告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      | —              | —            |
| 2  | 央行票据      | —              | —            |
| 3  | 金融债券      | —              | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —              | —            |
| 4  | 企业债券      | 98,954,012.44  | 97.22        |
| 5  | 企业短期融资券   | —              | —            |
| 6  | 中期票据      | 9,236,700.00   | 9.07         |
| 7  | 可转债（可交换债） | —              | —            |
| 8  | 同业存单      | —              | —            |
| 9  | 其他        | —              | —            |
| 10 | 合计        | 108,190,712.44 | 106.29       |

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|-------|---------|--------------|
|----|------|------|-------|---------|--------------|

|   |        |        |         |               |      |
|---|--------|--------|---------|---------------|------|
| 1 | 136190 | 16正才02 | 100,000 | 10,164,000.00 | 9.99 |
| 2 | 136096 | 16复星01 | 100,000 | 10,099,000.00 | 9.92 |
| 3 | 122850 | 11华泰债  | 100,000 | 10,012,000.00 | 9.84 |
| 4 | 112321 | 16龙基01 | 100,000 | 9,997,589.04  | 9.82 |
| 5 | 124832 | 14睢宁润  | 94,000  | 9,972,460.00  | 9.80 |

**5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名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   | 7,573.96     |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,646,125.59 |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | 2,341,485.01 |
| 5  | 应收申购款   | —            |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 3,995,184.56 |

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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) 转型前：财通纯债分级债券型证券投资基金 报告期（2016年1月1日-2016年1月18日）

### 5.12 报告期末（2016年1月18日）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   | —              | —             |
|    | 其中：股票  | —              | —             |
| 2  | 基金投资   | —              | —             |
| 3  | 固定收益投资 | 104,708,228.30 | 92.26         |
|    | 其中：债券  | 104,708,228.30 | 92.26         |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 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      | 5,268,727.34   | 4.64   |
| 8 | 其他资产              | 3,521,242.88   | 3.10   |
| 9 | 合计                | 113,498,198.52 | 100.00 |

### 5.13 报告期末（2016年1月18日）按行业分类的股票投资组合

#### 5.13.1 报告期末（2016年1月18日）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.13.2 报告期末（2016年1月18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（2016年1月18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

本基金本报告期末未持有股票。

### 5.15 报告期末（2016年1月18日）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      | 5,091,000.00  | 4.87         |
| 2  | 央行票据      | —             | —            |
| 3  | 金融债券      | —             | —            |
|    | 其中：政策性金融债 | —             | —            |
| 4  | 企业债券      | 80,025,228.30 | 76.51        |
| 5  | 企业短期融资券   | —             | —            |

|    |           |                |        |
|----|-----------|----------------|--------|
| 6  | 中期票据      | 19,592,000.00  | 18.73  |
| 7  | 可转债（可交换债） | —              | —      |
| 8  | 同业存单      | —              | —      |
| 9  | 其他        | —              | —      |
| 10 | 合计        | 104,708,228.30 | 100.11 |

**5.16 报告期末（2016年1月18日）按公允价值占基金资产净值比例大小排名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(元)       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 101480003 | 14营口沿海MTN001 | 100,000 | 10,430,000.00 | 9.97         |
| 2  | 122850    | 11华泰债        | 100,000 | 10,058,000.00 | 9.62         |
| 3  | 124832    | 14睢宁润        | 94,000  | 9,980,920.00  | 9.54         |
| 4  | 122096    | 11健康元        | 90,000  | 9,727,200.00  | 9.30         |
| 5  | 124334    | 13博国资        | 90,000  | 9,243,000.00  | 8.84         |

**5.17 报告期末（2016年1月18日）按公允价值占基金资产净值比例大小排名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（2016年1月18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（2016年1月18日）按公允价值占基金资产净值比例大小排名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（2016年1月18日）本基金投资的股指期货交易情况说明**

**5.20.1 报告期末（2016年1月18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

本基金不投资股指期货。

## 5.21 报告期末（2016年1月18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（2016年1月18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。

### 5.22.3 其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 11,078.70    |
| 2  | 应收证券清算款 | 999,420.83   |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | 2,510,743.35 |
| 5  | 应收申购款   | —            |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 3,521,242.88 |

### 5.22.4 报告期末（2016年1月18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（2016年1月18日）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。

### 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

|                                       |                |
|---------------------------------------|----------------|
| 基金转型起始日（2016年1月19日）基金份额总额             | 102,511,926.80 |
| 基金转型起始日至报告期期末基金总申购份额                  | 98.91          |
| 减：基金转型起始日至报告期期末基金总赎回份额                | 2,045,227.63   |
| 基金转型起始日至报告期期末基金拆分变动份额<br>（份额减少以“-”填列） | —              |
| 报告期期末基金份额总额                           | 100,466,798.08 |

注：(1)总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

(2)本报告期初纯债A基金份额总额为16,530,336.78份，2016年1月1日至2016年1月18日期间总申购份额为0，总赎回份额为2,066,706.61份，拆分变动份额为175,153.64份，2016年1月18日纯债A份额总额为16,705,490.42份；

(3)本报告期初纯债B基金份额总额为65,000,000.00份，2016年1月1日至2016年1月18日期间总申购份额为0，总赎回份额为0，拆分变动份额为22,883,148.69份，2016年1月18日纯债B份额总额为87,883,148.69份；

(4) 2016年1月19日终，本基金以份额转换后1.000元的基金份额净值为基准，纯债A和纯债B按照各自的基金份额净值转换为开放式债券型基金份额。纯债A的转换比例为0.999902404，纯债B的转换比例为0.999902404，其中份额经转换后的份额数保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。转换前纯债A和纯债B份额总额为104,588,639.11份，2016年1月18日当日纯债A的赎回（含转换转出）份额为2,066,706.61，转换前的份额总数为102,521,932.50份，转换后基金份额总额为102,511,926.80。

## §7 基金管理人运用固有资金投资基金情况

### 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》及管理人网站进行了如下信息披露：

1、2016年1月4日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下基金2015年年度资产净值的公告》；

2、2016年1月4日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金开放时间调整的公告》；

3、2016年1月5日披露了《关于财通纯债分级债券型证券投资基金到期转型的提示公告》；

4、2016年1月7日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金开放时间调整的公告》；

5、2016年1月9日披露了《关于财通纯债分级债券型证券投资基金到期转型的提示公告》；

6、2016年1月12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方华锦化学工业股份有限公司股份情况的公告》；

7、2016年1月13日披露了《财通基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金单笔申购最低金额的公告》；

8、2016年1月13日披露了《关于财通基金管理有限公司微信网上直销系统端口上线及实施费率优惠活动的公告》；

9、2016年1月14日披露了《厦门象屿股份有限公司简式权益变动报告书》；

10、2016年1月15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烟台双塔食品股份有限公司情况的公告》；

11、2016年1月15日披露了《财通纯债分级债券型证券投资基金开放日常赎回（转换出）业务的公告》；

12、2016年1月16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亿晶光电科技股份有限公司情况的公告》；

13、2016年1月16日披露了《关于财通纯债分级债券型证券投资基金到期转型的提示公告》；

14、2016年1月20日披露了《财通纯债分级债券型证券投资基金2015年第4季度报告》；

15、2016年1月21日披露了《关于财通纯债分级债券型证券投资基金基金份额折算、赎回及基金份额转换结果的公告》；

16、2016年1月25日披露了《基金销售网点及销售人员资格信息一览表》；

17、2016年1月29日披露了《关于财通基金管理有限公司增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问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、2016年2月3日披露了《北京城建投资发展股份有限公司简式权益变动报告书》；

19、2016年2月5日披露了《财通纯债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回(转换、定投)业务的公告》；

20、2016年2月16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甘肃靖远煤电股份有限公司情况的公告》；

21、2016年3月1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安徽全柴动力股份有限公司情况的公告》；

22、2016年3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中珠控股股份有限公司情况的公告》；

23、2016年3月17日披露了《关于财通基金管理有限公司增加上海利得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》；

24、2016年3月24日披露了《关于财通基金管理有限公司增加平安证券有限责任公司为代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告》；

25、2016年3月26日披露了《财通纯债债券型证券投资基金2015年年度报告》及其摘要；

26、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、财通纯债分级债券型证券投资基金基金合同；
- 3、财通纯债分级债券型证券投资基金托管协议；
- 4、财通纯债债券型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  
二〇一六年四月二十二日