

财通多策略升级混合型证券投资基金2016年半年度报告摘要

2016年6月30日

基金管理人：财通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016年8月26日

§1 重要提示

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。本报告中财务资料未经审计。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年3月9日（基金合同生效日）起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	财通多策略升级混合
场内简称	财通升级
基金主代码	501015
交易代码	501015
基金运作方式	契约型。基金合同生效后，本基金设一个18个月的封闭期，起讫时间为基金合同生效之日至18个月后的对应日（若该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日）止。在封闭期内，本基金不开放申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过上海证券交易所转让基金份额。封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。
基金合同生效日	2016年3月9日
基金管理人	财通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,646,865,157.19份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016年6月6日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将灵活运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金综合分析国内外政治经济环境、经济基本面状况、宏观政策变化、金融市场形势等多方面因素，通过对货币市场、债券市场和股票市场的整体估值状况比较分析，对各主要投资品种市场的未来发展趋势进行研判，根据判断结果进行资产配置及组合的构建，确定基金在股票、债券、货币市场工具等资产类别上

	<p>的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态调整各资产类别的投资比例，在控制投资组合整体风险基础上力争提高收益。</p> <p>本基金在价值投资理念的基础上，建立成长策略、主题策略、定向增发策略以及动量策略等多策略体系，并根据市场环境的变化进行针对性运用；固定收益投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用风险管理和时机策略相结合的积极性投资方法；权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，结合权证的溢价率、隐含波动率、到期日等指标，选择权证的买入和卖出时机；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。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于中高风险、中高收益的基金产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	财通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄惠
	联系电话	021-20537888
	电子邮箱	service@ctfund.com
客户服务电话	400-820-9888	95588
传真	021-20537999	010-66105798

2.4 信息披露方式

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

基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址
-------------	-----------------

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016年3月9日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-16,321,663.45
本期利润	79,777,638.60
加权平均基金份额本期利润	0.0172
本期基金份额净值增长率	1.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0035
期末基金资产净值	4,726,642,795.79
期末基金份额净值	1.017

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；

(4)本基金的《基金合同》生效日为2016年3月9日，至本报告期末未满半年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至2016年6月30日的的数据。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.60%	0.30%	-0.11%	0.54%	1.71%	-0.24%
过去三个月	1.80%	0.21%	-0.73%	0.55%	2.53%	-0.34%
自基金合同生效日起	1.70%	0.18%	1.47%	0.60%	0.23%	-0.42%

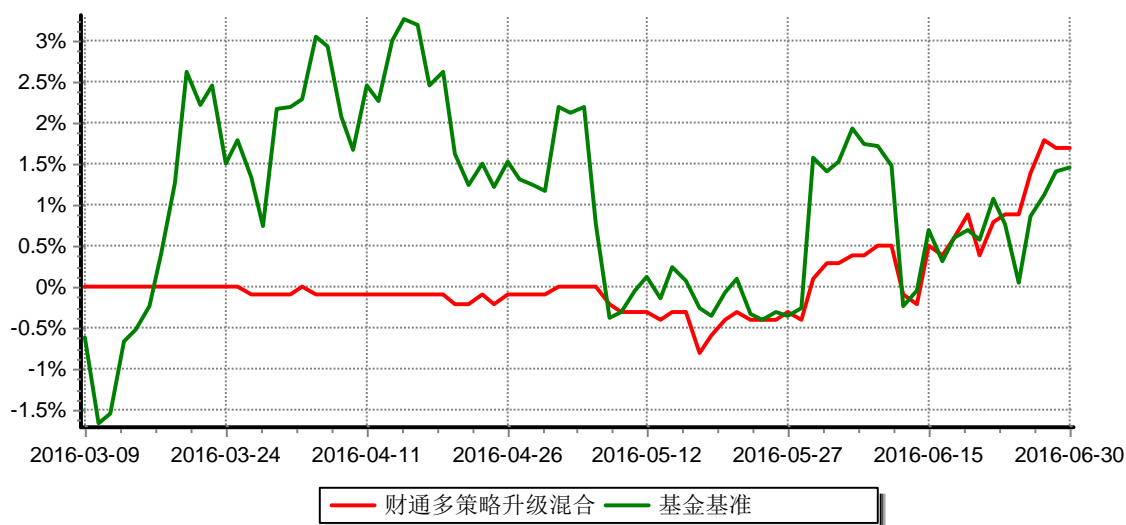
至今（2016年03月09日-2016年06月30日）						
-----------------------------	--	--	--	--	--	--

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：沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

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

财通多策略升级混合型证券投资基金
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3月9日-2016年6月30日)



注：(1)本基金合同生效日为2016年3月9日，基金合同生效起至披露时点不满一年；

(2)根据《基金合同》规定：股票资产比例为基金资产的30%~95%；债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种的比例为基金资产的0%~70%；在封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金建仓期是2016年3月9日至2016年9月9日，截至报告期末，本基金处于建仓期，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。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

公司现有员工150余人，管理人员和主要业务骨干的证券、基金从业平均年限在10年以上。通过提供多维度、人性化的客户服务，财通基金始终与持有人保持信息透明；通过建立完备的风险控制体系，财通基金最大限度地保证客户的利益。公司将以专业的投资能力、规范的公司治理、诚信至上的服务、力求创新的精神为广大投资者创造价值。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姚思劫	本基金的基金经理	2016年3月9日	—	5年	复旦大学理学学士、管理学硕士。2011年7月加入财通基金管理有限公司，历任财通基金管理有限公司助理研究员、研究员，研究行业覆盖汽车、机械、公用事业等，重点关注高端装备制造等战略新兴产业，现任基金投资部的基金经理。

注：(1)基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

(2)非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

(3)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券

投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

同时，公司逐步建立健全公司各投资组合均可参考的投资对象备选库和交易对手备选库，在此平台上共享研究成果，并对各组合提供无倾向性支持；在公用备选库的基础上，各投资组合经理根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库，进而根据投资授权构建具体的投资组合。在确保投资组合间信息隔离、权限明晰的基础上，形成信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

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

报告期内，本基金参与上市公司定向增发项目，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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年二季度，国内经济基本面在地产复苏的带动下有所企稳，但地产新开工情况依然不佳，预计经济中长期处于平稳区间。同时，由于自去年开始美联储进入加息周期，使得市场对于资金回流美国的预期较为担心，英国脱欧以后全球主要货币相对美元贬值的压力持续增强，这都对国内市场的风险偏好提升造成了压力。成长股在经历了一季度的大幅杀跌之后已经有了一定的估值修复动力，以新能源、半导体、传媒、互联网为代表的新兴产业仍有望脱颖而出。

通过对行业及公司基本面的深入分析和合理的价值评估，我们在报告期内继续坚持成长股投资，在市场没有发生彻底变化的情况下，仍将大比例配置新兴产业中的龙头公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金净值增长率为1.70%，业绩比较基准增长率为1.47%，跑赢业绩比较基准0.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为2016年中国经济仍将处于转型阶段。一方面经济下行压力和通货紧缩压力仍将持续，另一方面内需主要依靠基建投资和地产企稳支撑。在政策的刺激下，一季度受地产复苏的带动经济逐渐见底，但回升的力度有限；而全球经济都相对疲弱的情况下，特别是在英国脱欧以后增加的全球经济不确定性，使得出口改善的可能性不大，以“稳增长、增效益”为核心的财政政策以及“供给侧改革”两只手将逐渐解决产能过剩压力，在此期间，经济周期波动趋于平缓。从流动性来看，美元加息在一定程度上影响了全球流动性宽松的空间，但国内流动性总体保持相对宽松，预计边际改善将有所转弱。而资本市场在经历股灾之后，在政策的限制下，杠杆的运用显著下降，虽然长期来看居民资产向权益类转移的逻辑仍在，短期对市场的影响逐渐减弱。从资产收益率的角度来看，资产荒的现象确实在某些领域存在，权益类产品存在一定吸引力。我们预计未来市场整体波动空间将较2015年减小，有望重回结构性行情状态，存量博弈的概率较大。

作为十三五规划的开局之年，本届政府更加重视供给侧改革，这将使得煤炭、钢铁、有色等传统行业产能加快出清，加之联储加息之后不排除部分大宗商品存在阶段性反弹的可能，但持续性仍需观察。而传媒、大数据、新能源等战略新兴产业仍将代表新的增长方向，未来资本市场将通过改革、创新和转型三条主线挖掘机会，传统领域的改革是

事件性机会，可阶段性积极参与；创新和转型则代表新经济的未来，值得中长线布局。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

基金管理人与中国工商银行股份有限公司于2013年9月签订了《基金估值核算业务外包协议》，截至报告期末，基金管理人未对旗下公开募集证券投资基金及特定客户资产管理计划估值业务实行外包。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在封闭期内，本基金不进行收益分配。转换为上市开放式基金（LOF）后，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的25%；根据相关法律法规及基金合同的要求，结合本基金运作情况，本报告期内本基金未进行利润分配。

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，财通多策略升级混合型证券投资基金的管理人——财通基金管理有限公司在财通多策略升级混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，财通多策略升级混合型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基金管理有限公司编制和披露的财通多策略升级混合型证券投资基金2016年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：财通多策略升级混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日
资产：		
银行存款		1,480,846,925.00
结算备付金		1,062,234.52
存出保证金		69,760.37
交易性金融资产		2,644,210,834.22
其中：股票投资		2,644,210,834.22
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—

贵金属投资		—
衍生金融资产		—
买入返售金融资产		—
应收证券清算款		649,440,725.87
应收利息		329,492.83
应收股利		—
应收申购款		—
递延所得税资产		—
其他资产		—
资产总计		4,775,959,972.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日
负 债:		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债		—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		42,055,454.94
应付赎回款		—
应付管理人报酬		5,748,186.89
应付托管费		958,031.16
应付销售服务费		—
应付交易费用		452,216.61
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债		103,287.42
负债合计		49,317,177.02
所有者权益:		
实收基金		4,646,865,157.19

未分配利润		79,777,638.60
所有者权益合计		4,726,642,795.79
负债和所有者权益总计		4,775,959,972.81

注：(1)报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.017元，基金份额总额4,646,865,157.19份；

(2)后附会计报表附注为本会计报表的组成部分；

(3) 本基金成立于2016年3月9日，无比较式的上年度可比期间，因此资产负债表只列示2016年6月30日数据，特此说明。

6.2 利润表

会计主体：财通多策略升级混合型证券投资基金

本报告期：2016年3月9日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2016年3月9日至2016年6月30日
一、收入		105,597,780.08
1.利息收入		7,493,569.65
其中：存款利息收入		6,913,431.01
债券利息收入		—
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		580,138.64
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,004,908.38
其中：股票投资收益		-6,760,867.53
基金投资收益		—
债券投资收益		—
资产支持证券投资收益		—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益		—
股利收益		8,765,775.91

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		96,099,302.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5.其他收入（损失以“-”号填列）		—
减：二、费用		25,820,141.48
1. 管理人报酬		21,532,269.70
2. 托管费		3,588,711.61
3. 销售服务费		—
4. 交易费用		595,872.75
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用		103,287.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		79,777,638.60
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		79,777,638.60

注：(1)后附会计报表附注为本会计报表的组成部分；

(2)本基金成立于2016年3月9日，无比较式的上年度可比期间，因此利润表只列示从基金合同生效日至2016年6月30日数据，特此说明。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：财通多策略升级混合型证券投资基金

本报告期：2016年3月9日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年3月9日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	4,646,865,157.19	—	4,646,865,157.19
二、本期经营活动产生的基金	—	79,777,638.60	79,777,638.60

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)	4,646,865,157.19	79,777,638.60	4,726,642,795.79

注：本基金于2016年3月9日成立，无比较式的上年度可比期间，因此所有者权益变动表只列示从基金合同生效日至2016年6月30日数据，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

刘未

刘未

许志雄

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

财通多策略升级混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]3121号文《关于准予财通多策略升级混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人财通基金管理有限公司于2016年2月18日至2016年3月4日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2016)验字第60951782_B102号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年3月9日生效。本基金为契约型，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币4,645,216,679.92元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币1,648,477.27元，以上实收基金（本息）合计为人民币4,646,865,157.19元，折合4,646,865,157.19份基金份额。基金合同生效后，本基金设一个18个月的封闭期，起讫时间为基金合同生效之日至18个月后的对应日（若该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日）止。在封闭期内，本基金不开放申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过上海证券交易所转让基金份额。封闭期届满后，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。本基金的基金管理人为财通基金管理有限

公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。股票资产比例为基金资产净值的30%~95%；债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种的比例为基金资产净值的0%~70%；在封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2016年6月30日的财务状况以及2016年3月9日（基金合同生效日）至2016年6月30日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期会计报表的实际编制期间为2016年3月9日（基金合同生效日）至2016年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债；

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资

产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

(5)回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合

同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值。

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值。

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算。

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值。

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值。

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理。

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件

的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述2)、3)中的相关原则进行估值。

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算，并于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8)股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率逐日计提;

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提;

(3)卖出回购证券支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在封闭期内,本基金不进行收益分配。转换为上市开放式基金(LOF)后,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的25%;

(2)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4)每一基金份额享有同等分配权;

(5)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

3. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》

的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4. 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

财通基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
财通证券股份有限公司("财通证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易

6.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期未有应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月9日（基金合同生效日）至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	21,532,269.70
其中：支付销售机构的客户维护费	5,973,596.47

注：(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日计提，按月支

付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延；

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

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

(4) 本基金于2016年3月9日成立，无比较式的上年度数据。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年3月9日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,588,711.61

注：(1)支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延；

(2)基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 ×0.25% / 当年天数；

(3) 本基金于2016年3月9日成立，无比较式的上年度数据。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2016年3月9日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入

中国工商银行 活期存款	1,480,846,925.00	6,893,846.46
----------------	------------------	--------------

注：(1)本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息；

(2) 本基金于2016年3月9日成立，无比较式的上年度数据。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项的说明。

6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
002244	滨江集团	2016-03-30	2017-03-31	增发流通受限	6.76	6.7	14,790,000	99,980,400	99,093,000
000735	罗牛山	2016-04-12	2017-04-13	增发流通受限	6.08	6.16	16,447,368	99,999,997.44	101,315,786.88
002027	分众传媒	2016-04-14	2017-04-17	增发流通受限	9.78	11.24	15,151,516	150,000,008.4	170,303,039.84
002617	露笑科技	2016-04-15	2017-04-19	增发流通受限	10.71	11.74	2,631,506	28,249,996.25	30,893,880.44
002380	科远股份	2016-04-18	2017-04-19	增发流通受限	25.98	27.72	2,191,465	57,000,004.65	60,747,409.8
300310	宜通世纪	2016-04-18	2017-04-18	增发流通受限	20.50	24.2	6,331,811	129,999,998.7	153,229,826.2
300433	蓝思科技	2016-04-20	2017-05-11	增发流通受限	19.28	20.96	5,098,572	99,999,992.16	106,866,069.12
300304	云意电气	2016-04-21	2017-04-21	增发流通受限	20.30	22.62	1,816,049	37,229,004.5	41,079,028.38
002546	新联电子	2016-04-21	2017-04-24	增发流通受限	10.51	10.85	9,990,485	104,999,997.35	108,396,762.25
000690	宝新能源	2016-04-25	2017-04-26	增发流通受限	6.70	6.72	14,492,753	99,999,995.7	97,391,300.16
300287	飞利信	2016-04-26	2017-04-27	增发流通受限	10.95	11.4	10,081,952	110,699,832.96	114,934,252.8
002607	亚夏汽车	2016-05-04	2017-05-05	增发流通受限	10.12	10.34	9,881,419	99,999,960.28	102,173,872.46

002654	万润科技	2016-05-05	2017-05-08	增发流通受限	12.18	12.72	3,453,269	42,060,816.42	43,925,581.68
600497	驰宏锌锗	2016-05-06	2017-05-04	增发流通受限	9.41	9.5	9,787,460	92,099,998.6	92,980,870
300342	天银机电	2016-05-06	2017-05-05	增发流通受限	22.37	23.64	526,711	11,886,122.85	12,451,448.04
601222	林洋能源	2016-05-12	2017-05-10	增发流通受限	30.68	32.25	2,623,859	80,499,994.12	84,619,452.75
603885	吉祥航空	2016-05-12	2017-05-11	增发流通受限	22.82	23.3	4,382,121	100,000,001.22	102,103,419.3
000420	吉林化纤	2016-05-13	2017-05-17	增发流通受限	6.4	6.44	14,984,375	95,900,000	96,499,375
600346	*ST橡塑	2016-05-16	2017-05-12	增发流通受限	6.36	5.81	10,137,301	64,473,234.36	58,897,718.81
300166	东方国信	2016-05-16	2017-05-17	增发流通受限	22.88	23.48	2,277,098	52,100,002.24	53,466,261.04
300410	正业科技	2016-05-19	2017-05-18	增发流通受限	33.5	35.38	696,517	23,333,319.5	24,642,771.46
002745	木林森	2016-05-26	2017-05-29	增发流通受限	28.01	28.6	2,820,421	78,999,992.21	80,664,040.6
300419	浩丰科技	2016-06-13	2017-06-15	增发流通受限	36.35	36.68	1,075,529	39,095,479.15	39,450,403.72
603118	共进股份	2016-06-22	2017-06-19	增发流通受限	34.5	34.68	1,565,217	53,999,986.5	54,281,725.56
002432	九安医疗	2016-06-24	2017-06-27	增发流通受限	15.2	15.26	6,578,950	100,000,040	100,394,777
000591	太阳能	2016-06-24	2017-06-28	增发流通受限	13	13.04	9,999,997	129,999,961	130,399,960.88
603019	中科曙光	2016-06-30	2017-06-28	增发流通受限	32.54	32.57	1,536,570	49,999,987.8	50,046,084.9
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新发流通受限	5.8	5.8	971	5,631.8	5,631.8
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新发流通受限	10.05	10.05	926	9,306.3	9,306.3

注：(1) 实际可流通日以上上市公司届时发布的公告为准；

(2) 认购价格为上市公司实施分红派息除权后的价格。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
------	------	------	------	--------	------	--------	----	--------	--------

601611	中国核建	2016-06-30	交易异常波动	20.92	2016-07-01	23.01	37,059	128,594.73	775,274.28
--------	------	------------	--------	-------	------------	-------	--------	------------	------------

注：(1)流通受限股票的复牌日期以上市公司发布的公告时间为准；

(2) 本基金通过认购上市公司非公开发行股票的方式获取的驰宏锌锗(600497)、九安医疗(002432)、露笑科技(002617)、万润科技(002654)和东方国信(300166)分别于2016年6月13日、2016年6月20日、2016年5月9日、2016年5月9日及2016年6月8日起停牌。上述股票的相关信息详见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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至报告期末，本基金无需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,644,210,834.22	55.37
	其中：股票	2,644,210,834.22	55.37
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	1,481,909,159.52	31.03

7	其他各项资产	649,839,979.07	13.61
8	合计	4,775,959,972.81	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	103,506,286.88	2.19
B	采矿业	92,980,870.00	1.97
C	制造业	1,369,374,496.01	28.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	227,791,261.04	4.82
E	建筑业	775,274.28	0.02
F	批发和零售业	113,429,880.46	2.40
G	交通运输、仓储和邮政业	102,103,419.30	2.16
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	362,780,236.16	7.68
J	金融业	—	—
K	房地产业	99,093,000.00	2.10
L	租赁和商务服务业	170,303,039.84	3.60
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	2,073,070.25	0.04
S	综合	—	—
	合计	2,644,210,834.22	55.94

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通机制投资的港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002027	分众传媒	15,151,516	170,303,039.84	3.60
2	300310	宜通世纪	6,331,811	153,229,826.20	3.24
3	603806	福斯特	2,769,531	144,541,822.89	3.06
4	600006	东风汽车	15,756,958	139,764,217.46	2.96
5	000591	太阳能	9,999,997	130,399,960.88	2.76
6	300287	飞利信	10,081,952	114,934,252.80	2.43
7	002546	新联电子	9,990,485	108,396,762.25	2.29
8	300433	蓝思科技	5,098,572	106,866,069.12	2.26
9	300031	宝通科技	4,070,409	103,876,837.68	2.20
10	002607	亚夏汽车	9,881,419	102,173,872.46	2.16

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002027	分众传媒	150,000,008.40	3.17
2	600006	东风汽车	140,355,899.61	2.97
3	603806	福斯特	134,017,633.15	2.84
4	300310	宜通世纪	129,999,998.70	2.75
5	000591	太阳能	129,999,961.00	2.75
6	300287	飞利信	110,699,832.96	2.34
7	002546	新联电子	104,999,997.35	2.22

8	002432	九安医疗	100,000,040.00	2.12
9	603885	吉祥航空	100,000,001.22	2.12
10	000735	罗牛山	99,999,997.44	2.12
11	000690	宝新能源	99,999,995.70	2.12
12	300433	蓝思科技	99,999,992.16	2.12
13	002607	亚夏汽车	99,999,960.28	2.12
14	002244	滨江集团	99,980,400.00	2.12
15	300031	宝通科技	97,748,111.65	2.07
16	000420	吉林化纤	95,900,000.00	2.03
17	600497	驰宏锌锗	92,099,998.60	1.95
18	601222	林洋能源	80,499,994.12	1.70
19	002745	木林森	78,999,992.21	1.67
20	600346	*ST橡塑	64,473,234.36	1.36

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600079	人福医药	46,853,958.53	0.99
2	002361	神剑股份	2,670,010.00	0.06
3	002747	埃斯顿	2,229,532.54	0.05
4	601888	中国国旅	1,871,965.89	0.04
5	300011	鼎汉技术	1,777,095.00	0.04
6	300420	五洋科技	1,723,205.00	0.04
7	300161	华中数控	1,653,695.00	0.03
8	002014	永新股份	1,648,825.20	0.03
9	002548	金新农	1,648,027.00	0.03
10	002674	兴业科技	1,581,081.20	0.03
11	600990	四创电子	1,574,571.00	0.03
12	000911	南宁糖业	1,498,515.00	0.03

13	600600	青岛啤酒	1,457,418.24	0.03
14	002714	牧原股份	1,435,772.00	0.03
15	600109	国金证券	1,389,500.00	0.03
16	600690	青岛海尔	1,336,500.00	0.03
17	000070	特发信息	1,188,066.00	0.03
18	000523	广州浪奇	1,182,239.00	0.03
19	603901	永创智能	1,125,092.00	0.02
20	002624	完美世界	1,119,138.00	0.02

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,633,099,985.98
卖出股票的收入（成交）总额	78,227,586.28

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内未投资贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	69,760.37
2	应收证券清算款	649,440,725.87
3	应收股利	—
4	应收利息	329,492.83
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—

8	其他	—
9	合计	649,839,979.07

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002027	分众传媒	170,303,039.84	3.60	非公开发行
2	300310	宜通世纪	153,229,826.20	3.24	非公开发行
3	000591	太阳能	130,399,960.88	2.76	非公开发行
4	300287	飞利信	114,934,252.80	2.43	非公开发行
5	002546	新联电子	108,396,762.25	2.29	非公开发行
6	300433	蓝思科技	106,866,069.12	2.26	非公开发行
7	002607	亚夏汽车	102,173,872.46	2.16	非公开发行

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
44,792	103,743.19	778,695,338.74	16.76%	3,868,169,818.45	83.24%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	浙江大家祥驰投资有限公司	50,001,250	2.49%
2	朱如云	18,006,300	0.90%
3	邵晓航	10,006,750	0.50%
4	新昌县三花小额贷款股份有限公司	10,003,400	0.50%
5	北京乐瑞资产管理有限公司——乐瑞宏观配置4号基金	9,999,900	0.50%
6	王玉清	9,999,900	0.50%
7	林晓晶	9,999,450	0.50%
8	樊宇炘	8,004,040	0.40%
9	王润泽	7,003,095	0.35%
10	曹险峰	6,500,755	0.32%

注：上述份额持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	343,589.67	0.01%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

注：(1)本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0；

(2)本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年3月9日)基金份额总额	4,646,865,157.19
基金合同生效日基金份额总额	4,646,865,157.19
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	—
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	—
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	4,646,865,157.19

注：基金合同生效后，本基金设一个18个月的封闭期，起讫时间为基金合同生效之日至18个月后的对应日（若该日为非工作日，则为该日之前的最后一个工作日）止。在封闭期内，本基金不开放申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过上海证券交易所转让基金份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	138,434,248.39	23.94%	101,236.85	21.71%	—
长江证券	2	37,899,327.83	6.55%	27,156.48	5.82%	—
国金证券	1	1,278,956	0.22%	1,191.09	0.26%	—
国信证券	2	151,643,312.84	26.22%	108,823.21	23.34%	—
华创证券	2	10,826,957.59	1.87%	7,738.12	1.66%	—
联讯证券	2	42,051,724.75	7.27%	38,784.67	8.32%	—
山西证券	1	4,497,532	0.78%	3,199.11	0.69%	—
申银万国	2	62,671,072.15	10.84%	58,284.62	12.5%	—
湘财证券	1	1,009,947.59	0.17%	920.38	0.2%	—
招商证券	2	87,592,950.97	15.14%	81,378.8	17.45%	—
中信证券	2	40,460,209.96	7%	37,626.59	8.07%	—

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

户开户手续。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
长城证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—	—	—
联讯证券	—	—	—	—	—	—
山西证券	—	—	—	—	—	—
申银万国	—	—	3,000,000,000	100%	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—

财通基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日