

财通多策略福享混合型证券投资基金2017年半年度报告摘要

2017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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017年8月24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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年8月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	财通多策略福享混合
场内简称	财通福享
基金主代码	501026
交易代码	501026
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9月18日
基金管理人	财通基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,583,569,764.88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12月15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的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变

	<p>化。</p> <p>在投资运作的过程中，将综合运用价值、成长、周期、主题、定向增发、动量等多种投资策略，构建基金的股票投资组合。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。在严格控制风险的前提下进行权证投资。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。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，将通过研究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。</p>
业绩比较基准	<p>沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%</p>
风险收益特征	<p>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。</p>

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	中国农业银行股份有限公司
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	010-68121816

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	<p>http://www.ctfund.com</p>
基金半年度报告备置地点	<p>基金管理人和基金托管人办公地址</p>

§ 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（2017年1月1日至2017年6月30日）
本期已实现收益	-17,274,897.29
本期利润	-185,540,012.90
加权平均基金份额本期利润	-0.0405
本期基金份额净值增长率	-4.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0526
期末基金资产净值	4,342,679,766.00
期末基金份额净值	0.9474

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

(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

(3)期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

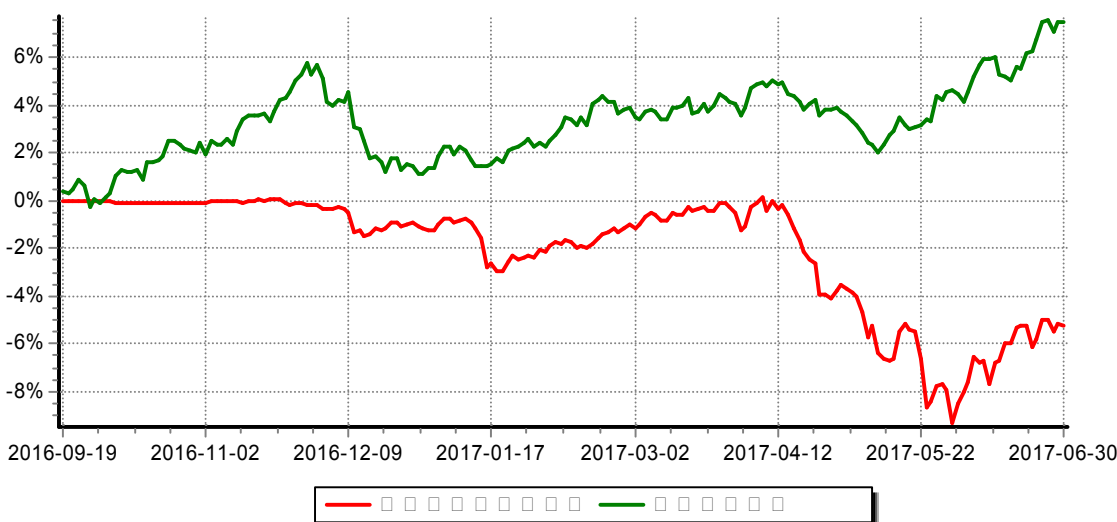
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.88%	0.70%	2.80%	0.37%	0.08%	0.33%
过去三个月	-4.22%	0.67%	3.41%	0.34%	-7.63%	0.33%
过去六个月	-4.10%	0.51%	6.03%	0.31%	-10.13%	0.20%
自基金合同生效日起至今（2016年9月18日-2017年06月30日）	-5.26%	0.42%	7.46%	0.35%	-12.72%	0.07%

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：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

财通多策略福享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9月18日-2017年6月30日)



注：(1)本基金合同生效日为2016年9月18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、等固定收益品种以及货币市场工具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9月18日至2017年3月18日，截至报告期末和基金建仓期末，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瀚叶股份有限公司（原“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183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9月18日	—	6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“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

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

(3)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 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，本期内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

2017年二季度，随着一二线城市限购政策影响逐步显现，地产冷却降低了市场对经济复苏趋势放缓的预期，经济中长期仍将处于平稳区间。国际油价从高位开始略有回落，带动国内PPI调整，基本确认了一季度为PPI全年高点的判断。美国加息靴子落地，对国内市场的资金利率预计将造成趋势性的压力，持续IPO对市场整体估值水平形成压制，未来市场将更多关注具备相对较高确定性的行业和个股，同时符合产业转型升级方向的新能源、半导体、高端制造等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投资景气度提升的行业板块，从中优选行业龙头和综合竞争力提升的公司，努力获得超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017年上半年度，本基金净值增长率为-4.10%，业绩比较基准增长率为6.03%，跑输业绩比较基准10.13%。

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2017年中国经济仍将处于转型阶段。2016年一季度开始受地产复苏的带动经济逐渐见底回升，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。随着原油价格回调，PPI上升受阻，通胀预期开始回落。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。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收窄，有望重回结构性行情状态，存量博弈的概率较大。

根据中央经济工作会议精神，本届政府更加重视国企改革的深入推进，加快资本脱虚入实的步伐，需要重点关注制造业，特别是高端制造业以及具备全球行业龙头潜质的公司，同时在传媒、大数据、新能源等战略新兴产业寻找新的增长方向。未来资本市场将通过改革、创新和转型三条主线挖掘机会，是中长线布局的主要方向。

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%；

本报告期内本基金未进行过利润分配。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—财通基金管理有限公司2017年1月1日至2017年6月30日基金的投资运作，进行

了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，财通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，财通基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：财通多策略福享混合型证券投资基金

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	73,005,944.45	386,048,845.00
结算备付金		4,450,000.00	35,454,545.45
存出保证金		80,942.72	—
交易性金融资产	6.4.7.2	3,702,382,140.32	1,802,023,072.33
其中：股票投资		3,512,535,140.32	1,578,514,572.33
基金投资		—	—
债券投资		189,847,000.00	223,508,500.00
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	564,041,811.06	1,501,277,691.91
应收证券清算款		284,691.58	806,211,605.32
应收利息	6.4.7.5	4,741,503.58	4,200,036.46
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		4,348,987,033.71	4,535,215,796.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
负 债:			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		5,280,626.33	5,776,046.86
应付托管费		880,104.41	962,674.49
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	5,922.82	47,296.22
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	140,614.15	210,000.00
负债合计		6,307,267.71	6,996,017.57
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	4,583,569,764.88	4,583,569,764.88
未分配利润	6.4.7.10	-240,889,998.88	-55,349,985.98
所有者权益合计		4,342,679,766.00	4,528,219,778.90

负债和所有者权益总计		4,348,987,033.71	4,535,215,796.47
------------	--	------------------	------------------

注：(1)后附会计报表附注为本会计报表的组成部分；

(2)报告截止日2017年6月30日，基金份额净值0.9474元，基金份额总额4,583,569,764.88份。

6.2 利润表

会计主体：财通多策略福享混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-146,531,667.40
1.利息收入		15,347,546.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,491,685.28
债券利息收入		2,052,607.85
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		7,803,253.35
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,385,901.73
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-6,839,414.98
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	92,555.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	6.4.7.14	—
股利收益	6.4.7.15	13,132,761.71
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-168,265,115.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	—
减：二、费用		39,008,345.50
1. 管理人报酬		33,054,125.85
2. 托管费		5,509,020.96
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.18	276,058.04
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	6.4.7.19	169,140.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-185,540,012.90
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-185,540,012.90

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9月18日，无比较式的上年度可比期间特此说明。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：财通多策略福享混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年1月1日至2017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)	4,583,569,764.88	-55,349,985.98	4,528,219,778.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-185,540,012.90	-185,540,012.90
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）	4,583,569,764.88	- 240,889,998.88	4,342,679,766.00

注：(1)本基金成立于2016年9月18日，无比较式的上年度可比期间特此说明;(2) 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;

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:

王家俊

王家俊

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

财通多策略福享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〔2016〕1432号文《关于准予财通多策略福享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8月15日至2016年9月9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_B368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9月18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4,581,206,487.39元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币2,354,277.49元，以上实收基金（本息）合计为人民币4,583,560,764.88元，折合4,583,560,764.88份基金份额。本基金的基金管理人为财通基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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。基金的投资组合比例为: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、银行存款等固定收益品种以及货币市场工具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2017年6月30日的财务状况以及2017年上半年度的经营成果和净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1.印花稅

經國務院批准，財政部、國家稅務總局研究決定，自2008年4月24日起，調整證券（股票）交易印花稅稅率，由原先的3‰調整為1‰；

經國務院批准，財政部、國家稅務總局研究決定，自2008年9月19日起，調整由出讓方按證券（股票）交易印花稅稅率繳納印花稅，受讓方不再徵收，稅率不變；

根據財政部、國家稅務總局財稅[2005]103號文《關於股權分置試點改革有關稅收政策問題的通知》的規定，股權分置改革過程中因非流通股股東向流通股股東支付對價而發生的股權轉讓，暫免徵收印花稅。

2.營業稅、增值稅

根據財政部、國家稅務總局財稅[2004]78號文《關於證券投資基金稅收政策的通知》的規定，自2004年1月1日起，對證券投資基金（封閉式證券投資基金，開放式證券投資基金）管理人運用基金買賣股票、債券的差價收入，繼續免徵營業稅；

根據財政部、國家稅務總局財稅[2016]36號文《關於全面推開營業稅改增值稅試點的通知》的規定，經國務院批准，自2016年5月1日起在全國範圍內全面推開營業稅改徵增值稅試點，金融業納入試點範圍，由繳納營業稅改為繳納增值稅。對證券投資基金（封閉式證券投資基金，開放式證券投資基金）管理人運用基金買賣股票、債券的轉讓收入免徵增值稅；國債、地方政府債利息收入以及金融同業往來利息收入免徵增值稅；存款利息收入不徵收增值稅；

根據財政部、國家稅務總局財稅[2016]46號文《關於進一步明確全面推開營改增試點金融業有關政策的通知》的規定，金融機構開展的質押式買入返售金融商品業務及持有政策性金融債券取得的利息收入屬於金融同業往來利息收入；

根據財政部、國家稅務總局財稅[2016]70號文《關於金融機構同業往來等增值稅政策的補充通知》的規定，金融機構開展的買斷式買入返售金融商品業務、同業存款、同業存單以及持有金融債券取得的利息收入屬於金融同業往來利息收入；

根據財政部、國家稅務總局財稅[2016]140號文《關於明確金融、房地產開發、教育輔助服務等增值稅政策的通知》的規定，資管產品運營過程中發生的增值稅應稅行為，以資管產品管理人為增值稅納稅人；

根據財政部、國家稅務總局財稅[2017]56號文《關於資管產品增值稅有關問題的通知》的規定，自2018年1月1日起，資管產品管理人運營資管產品過程中發生的增值稅應稅行為（以下簡稱“資管產品運營業務”），暫適用簡易計稅方法，按照3%的徵收率繳納增值稅，資管產品管理人未分別核算資管產品運營業務和其他業務的銷售額和增值稅應納稅額的除外。資管產品管理人可選擇分別或匯總核算資管產品運營業務銷售額和增值稅應納稅額。對資管產品在2018年1月1日前運營過程中發生的增值稅應稅行為，未繳納增值稅的，不再繳納；已繳納增值稅的，已納稅額從資管產品管理人以

后月份的增值税应纳税额中抵减。

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[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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

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
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
财通证券	168,055,649.73	67.04%

注：本基金于2016年9月18日成立，无比较式的上年度数据。

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6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	11,300,000,000.00	62.99%

注：本基金于2016年9月18日成立，无比较式的上年度数据。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券	119,936.44	66.8%	0	0

注：(1)上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示；

(2)该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务；

(3) 本基金于2016年9月18日成立，无比较式的上年度数据。

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 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	33,054,125.85
其中：支付销售机构的客户维护费	10,084,359.47

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2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延；

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

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

(4) 本基金于2016年9月18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 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,509,020.96

注：(1)支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延；
 (2)基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数；
 (3) 本基金于2016年9月18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。

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 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行 活期存款	73,005,944.45	1,081,228.58

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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（2017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

财通多策略福享混合型证券投资基金2017年半年度报告

000519	中兵红箭	2017-01-25	2018-01-25	增发受限	12.13	12.33	7,412,448	89,912,994.24	91,395,483.84
000555	神州信息	2016-12-28	2017-12-29	增发受限	25.57	16.7	1,564,333	39,999,994.81	26,124,361.1
000767	漳泽电力	2017-01-20	2018-01-23	增发受限	3.62	3.43	10,368,119	37,532,590.78	35,562,648.17
000778	新兴铸管	2017-04-05	2018-04-06	增发受限	5.15	5.53	17,320,388	89,199,998.2	95,781,745.64
000807	云铝股份	2016-11-18	2017-11-20	增发受限	5.2	6.44	14,476,923	75,279,999.6	93,231,384.12
000862	银星能源	2017-01-17	2018-01-10	增发受限	7.03	7.42	12,802,276	90,000,000.28	94,992,887.92
000875	吉电股份	2017-01-03	2018-01-04	增发受限	5.6	5.05	17,375,000	97,300,000	87,743,750
000901	航天科技	2016-11-17	2017-11-20	增发受限	30.72	27.16	4,424,199	135,911,393.28	120,161,244.84
001896	豫能控股	2017-04-26	2018-04-27	增发受限	9.3	7.02	6,170,039	57,381,362.7	43,313,673.78
002073	软控股份	2016-11-03	2017-11-06	增发受限	10.3	8.48	9,563,106	98,499,991.8	81,095,138.88
002124	天邦股份	2017-03-14	2018-03-16	增发受限	10.85	8.66	3,940,373	42,753,047.05	34,123,630.18
002150	通润装备	2016-11-15	2017-11-03	增发受限	15.95	11.75	1,947,117	31,056,516.15	22,878,624.75
002157	正邦科技	2017-01-09	2018-01-03	增发受限	6.1	4.55	13,114,754	79,999,999.4	59,672,130.7
002171	楚江新材	2017-01-19	2018-01-22	增发受限	15.05	14.83	5,275,747	79,399,992.35	78,239,328.01
002235	安妮股份	2016-11-16	2017-11-10	增发受限	17.91	12.2	4,997,208	89,499,995.28	60,965,937.6
002268	卫士通	2017-03-22	2018-03-23	增发受限	18.41	16.82	5,052,630	92,999,978.3	84,985,236.6
002303	美盈森	2016-11-11	2017-11-14	增发受限	12.58	7.72	12,286,963	154,569,994.54	94,855,354.36
002310	东方园林	2016-11-10	2017-11-13	增发受限	13.94	15.7	3,593,974	50,099,997.56	56,425,391.8
002494	华斯股份	2016-11-09	2017-11-13	增发受限	16.18	14.58	2,827,565	45,750,001.7	41,225,897.7
002501	利源精制	2017-01-20	2018-01-24	增发受限	11.38	11.37	6,279,050	71,455,589	71,392,798.5
002547	春兴精工	2017-02-15	2018-02-19	增发受限	9.65	10.08	1,011,384	9,759,855.6	10,194,750.72
00260	姚记	2016-11-23	2017-	增发受限	18.86	13.94	1,235,	23,300,002	17,221,740

财通多策略福享混合型证券投资基金2017年半年度报告

5	扑克		11-27				419	.34	.86
300213	佳讯飞鸿	2016-11-01	2017-11-02	增发受限	12.85	8.99	6,178,988	79,399,995.8	55,549,102.12
300247	乐金健康	2016-12-05	2017-12-05	增发受限	9.43	6.66	1,739,233	16,400,967.19	11,583,291.78
300252	金信诺	2016-10-28	2017-10-31	增发受限	33.35	21.65	1,819,090	60,666,651.5	39,383,298.5
300366	创意信息	2016-12-09	2017-12-13	增发受限	18.5	16.76	4,486,486	82,999,991	75,193,505.36
300418	昆仑万维	2017-04-06	2018-04-06	增发受限	18.6	19.55	2,392,962	44,509,093.2	46,782,407.1
300421	力星股份	2016-10-18	2017-10-16	增发受限	30.72	27.37	3,479,818	106,900,008.96	95,242,618.66
300422	博世科	2016-10-26	2017-11-02	增发受限	14.47	15.55	6,225,706	90,099,990	96,809,728.3
300438	鹏辉能源	2017-03-27	2018-03-29	增发受限	30.42	25.2	1,972,386	59,999,982.12	49,704,127.2
600169	太原重工	2016-12-22	2017-12-22	增发受限	4.08	3.86	6,926,683	28,260,866.64	26,736,996.38
600200	江苏吴中	2016-10-17	2017-10-13	增发受限	17.49	13.2	4,642,647	81,199,896.03	61,282,940.4
600258	首旅酒店	2017-01-10	2018-01-10	增发受限	16.02	19.42	5,750,261	92,100,010.48	111,670,068.62
600277	亿利洁能	2017-02-14	2018-02-12	增发受限	6.93	7.27	14,397,949	99,777,786.57	104,673,089.23
600312	平高电气	2016-11-08	2017-11-06	增发受限	16.05	13.74	7,450,000	119,572,500	102,363,000
600339	中油工程	2017-01-19	2018-01-19	增发受限	6.16	6.3	17,855,715	109,991,204.4	112,491,004.5
600522	中天科技	2017-02-10	2018-02-08	增发受限	9.62	10.56	12,474,013	120,000,005.06	131,725,577.28
600531	XD豫光金	2016-12-20	2017-12-18	增发受限	7.5	7.36	10,660,400	79,953,000	78,460,544
600676	交运股份	2016-11-14	2017-11-10	增发受限	8.58	7.45	5,378,261	46,145,479.38	40,068,044.45
600699	均胜电子	2017-01-06	2018-01-04	增发受限	32.01	31.94	3,748,829	120,000,016.29	119,737,598.26
600864	哈投股份	2016-10-11	2017-10-09	增发受限	9.43	8.31	6,726,880	63,434,478.4	55,900,372.8
600879	航天电子	2017-02-24	2018-02-22	增发受限	8.24	8.43	12,143,290	99,999,993.15	102,367,934.7
601111	中国国航	2017-03-14	2018-03-12	增发受限	7.79	8.39	7,702,182	59,999,997.78	64,621,306.98

601618	中国中冶	2017-01-11	2018-01-08	增发受限	3.86	4.39	31,079,275	119,966,001.5	136,438,017.25
601877	正泰电器	2017-02-27	2018-02-22	增发受限	17.58	18.27	6,825,938	119,999,990.04	124,709,887.26
601969	海南矿业	2017-02-13	2018-02-09	增发受限	10.14	10.3	11,834,320	120,000,004.8	121,893,496
603799	华友钴业	2016-12-23	2017-12-21	增发受限	31.86	46.74	297,756	9,486,506.16	13,917,115.44
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新发流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新发流通受限	6.2	6.2	2,966	18,389.2	18,389.2
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新发流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新发流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新发流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新发流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新发流通受限	20.2	20.2	857	17,311.4	17,311.4
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新发流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新发流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36

注：实际可流通日以上市公司届时发布的公告为准；

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
600050	中国联通	2017-04-05	重大事项	7.47		—	350,300	2,414,425.00	2,616,741.00
600100	同方股份	2017-04-21	重大事项	14.12		—	174,700	2,408,859.00	2,466,764.00
601088	中国神华	2017-06-05	重大事项	22.29		—	138,400	2,456,530.00	3,084,936.00
601989	中国重工	2017-05-31	重大事项	6.21		—	320,800	2,409,684.00	1,992,168.00
300104	乐视网	2017-04-17	重大资产重组	30.68			68,193	2,412,153.27	2,092,161.24

00225 2	上海 莱士	2017- 04-21	重大事项	20.24			115,2 60	2,399,529. 20	2,332,862. 40
------------	----------	----------------	------	-------	--	--	-------------	------------------	------------------

注：本基金通过认购上市公司非公开发行股票的方式获取的亿利洁能（600277）、银星能源（000862）、春兴精工（002547）、金信诺（300252）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

1、公允价值

1)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

2)以公允价值计量的金融工具

(1)各层次金融工具公允价值

于2017年6月30日，本基金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中属于第一层次的余额为人民币116,937,611.94元，属于第二层次的余额为人民币3,583,352,367.14元，属于第三层次的余额为人民币2,092,161.24元。

于2016年12月31日，本基金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中属于第一层次的余额为人民币23,948,400.00元，属于第二层次的余额为人民币1,778,074,672.33元，无属于第三层次余额。

(2)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

(3)第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

2、承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

3、其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	3,512,535,140.32	80.77
	其中：股票	3,512,535,140.32	80.77
2	固定收益投资	189,847,000.00	4.37
	其中：债券	189,847,000.00	4.37
	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	564,041,811.06	12.97
	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	77,455,944.45	1.78
7	其他各项资产	5,107,137.88	0.12
8	合计	4,348,987,033.71	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比
----	------	---------	----------

			例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	241,822,031.76	5.57
C	制造业	2,083,681,182.41	47.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	320,129,682.67	7.37
E	建筑业	197,406,396.05	4.55
F	批发和零售业	2,446,875.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	110,332,386.43	2.54
H	住宿和餐饮业	111,670,068.62	2.57
I	信息传输、软件和信息技术服务业	242,188,427.02	5.58
J	金融业	28,175,192.64	0.65
K	房地产业	8,365,629.76	0.19
L	租赁和商务服务业	2,690,080.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	100,154,678.30	2.31
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	2,189,569.26	0.05
S	综合	61,282,940.40	1.41
	合计	3,512,535,140.32	80.88

7.2.2 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通过港股通机制投资的港股

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	601618	中国中冶	31,079,275	136,438,017.25	3.14
2	600522	中天科技	12,474,013	131,725,577.28	3.03

3	601877	正泰电器	6,825,938	124,709,887.26	2.87
4	601969	海南矿业	11,834,320	121,893,496.00	2.81
5	000901	航天科技	4,424,199	120,161,244.84	2.77
6	600699	均胜电子	3,748,829	119,737,598.26	2.76
7	600339	中油工程	17,855,715	112,491,004.50	2.59
8	600258	首旅酒店	5,750,261	111,670,068.62	2.57
9	600277	亿利洁能	14,397,949	104,673,089.23	2.41
10	600879	航天电子	12,143,290	102,367,934.70	2.36

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600699	均胜电子	120,000,016.29	2.65
2	600522	中天科技	120,000,005.06	2.65
3	601969	海南矿业	120,000,004.80	2.65
4	601877	正泰电器	119,999,990.04	2.65
5	601618	中国中冶	119,966,001.50	2.65
6	600339	中油工程	109,991,204.40	2.43
7	600879	航天电子	99,999,993.15	2.21
8	600277	亿利洁能	99,777,786.57	2.20
9	000875	吉电股份	97,300,000.00	2.15
10	002268	卫士通	92,999,978.30	2.05
11	600258	首旅酒店	92,100,010.48	2.03
12	000862	银星能源	90,000,000.28	1.99
13	000519	中兵红箭	89,912,994.24	1.99
14	000778	新兴铸管	89,199,998.20	1.97
15	002157	正邦科技	79,999,999.40	1.77
16	002171	楚江新材	79,399,992.35	1.75

17	002501	利源精制	71,455,589.00	1.58
18	601111	中国国航	59,999,997.78	1.33
19	300438	鹏辉能源	59,999,982.12	1.33
20	001896	豫能控股	57,381,362.70	1.27

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300248	新开普	55,889,303.29	1.23
2	300014	亿纬锂能	15,145,208.95	0.33
3	601952	苏垦农发	199,793.00	0.00
4	601878	浙商证券	184,186.83	0.00
5	002867	周大生	152,638.40	0.00
6	603980	吉华集团	106,919.00	0.00
7	603113	金能科技	104,249.96	0.00
8	002872	天圣制药	91,865.58	0.00
9	300660	江苏雷利	80,201.88	0.00
10	603728	鸣志电器	78,851.00	0.00
11	002880	卫光生物	75,229.24	0.00
12	002869	金溢科技	60,930.25	0.00
13	603855	华荣股份	59,470.40	0.00
14	603758	秦安股份	57,608.40	0.00
15	603767	中马传动	48,159.30	0.00
16	603197	保隆科技	47,099.24	0.00
17	300658	延江股份	45,487.80	0.00
18	002875	安奈儿	44,872.50	0.00
19	300662	科锐国际	44,231.76	0.00
20	002870	香山股份	43,963.38	0.00

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,182,838,413.25
卖出股票的收入（成交）总额	73,299,129.67

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

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	179,820,000.00	4.14
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	10,027,000.00	0.23
6	中期票据	—	—
7	可转债(可交换债)	—	—
8	其他	—	—
9	合计	189,847,000.00	4.37

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	160018	16付息国债18	1,800,000	179,820,000.00	4.14
2	011698789	16河钢集SCP005	100,000	10,027,000.00	0.23

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	80,942.72

2	应收证券清算款	284,691.58
3	应收股利	—
4	应收利息	4,741,503.58
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,107,137.88

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	601618	中国中冶	136,438,017.25	3.14	非公开发行
2	600522	中天科技	131,725,577.28	3.03	非公开发行
3	601877	正泰电器	124,709,887.26	2.87	非公开发行
4	601969	海南矿业	121,893,496.00	2.81	非公开发行
5	000901	航天科技	120,161,244.84	2.77	非公开发行
6	600699	均胜电子	119,737,598.26	2.76	非公开发行
7	600339	中油工程	112,491,004.50	2.59	非公开发行
8	600258	首旅酒店	111,670,068.62	2.57	非公开发行
9	600277	亿利洁能	104,673,089.23	2.41	非公开发行
10	600879	航天电子	102,367,934.70	2.36	非公开发行

注：根据上市公司公告，亿利洁能（股票代码：600277）自2017年3月6日起因重大资产重组停牌。

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
28,520	160,714.23	1,785,112,882.7 2	38.95%	2,798,456,882.1 6	61.05%

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	上海斯诺波投资管理有限 公司—私募工场自由之路 母基金证券投资基	21,305,698.00	4.9847%
2	上海汽车集团股权投资有 限公司—上汽投资—颀瑞 1号	17,267,743.00	4.04%
3	财通基金—中国银行—财 通基金—富春上益定增 3号资产管理计划	15,000,350.00	3.5095%
4	财通基金-中国银行-财通 基金-富春中益定增8号资 产管理计划	10,001,250.00	2.3399%
5	刘江波	8,009,345.00	1.8739%
6	渤海证券股份有限公司	7,797,036.00	1.8242%
7	财通基金-工商银行-富春 定增宝利22号资产管理计 划	7,004,040.00	1.6387%
8	耿玉珍	7,003,410.00	1.6385%
9	南京盛泉恒元投资有限公	6,807,367.00	1.5927%

	司一盛泉恒元定增套利多策略6号私募基金		
10	财通基金-工商银行-富春定增同利3号资产管理计划	5,002,600.00	1.1704%

注：前十名持有人为场内份额。

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	1,793,022.95	0.04%

注：(1)本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为10万份至50万份(含)；

(2)本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

8.4 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年9月18日)基金份额总额	4,583,560,764.88
本报告期期初基金份额总额	4,583,569,764.88
本报告期基金总申购份额	—
减：本报告期基金总赎回份额	—
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	4,583,569,764.88

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未发生变化，为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	2	168,055,649.73	67.04%	119,936.44	66.8%	—
方正证券	2	42,108,546.48	16.8%	30,377.66	16.92%	—
海通证券	1	—	—	—	—	—
天风证券	2	40,511,723.92	16.16%	29,223.05	16.28%	—

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
财通证券	—	—	11,300,000,000	62.99%	—	—
方正证券	—	—	4,540,000,000	25.31%	—	—
海通证券	—	—	1,400,000,000	7.8%	—	—
天风证券	—	—	700,000,000	3.9%	—	—

§ 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

报告期内本基金未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况发生。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，就本公司旗下部分基金参与新股发行申购存在申报金额超过基金总资产的情况，中国证券监督管理委员会（下称“中国证监会”）上海监管局于2017年2月22日对本基金管理人下发《关于对财通基金管理有限公司的监管提示函》（沪证监决（2017）54号）。本基金管理人已根据相关法律、行政法规和中国证监会的要求进行整改，并进一步优化内部控制，规范相关业务流程。要求基金经理下达新股申购投资

指令前，通过投资交易管理系统进行试算，同时降低投资组合可参与新股申购金额占组合总资产的比例上限。进一步加强基金经理对于合规风险的一线管控责任，同时，强化风险管理人员复核环节的责任心和审慎程度，避免类似情况再次发生。

本报告期内，就本公司专户业务情况，中国证券监督管理委员会（下称“中国证监会”）上海监管局于2017年6月14日对本公司下发《关于对财通基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》（沪证监决〔2017〕49号）。本公司已根据相关法律、行政法规和中国证监会的要求进行制订整改措施，完善规范体系，设立多道防线，主动识别和防范违法、违规行为，避免类似情况再次发生。

中国证券监督管理委员会于2017年5月27日发布《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》（下称“《规定》”），同日，沪深交易所分别就《规定》出具相关实施细则。《规定》及相关实施细则就大股东和参与非公开发行股票获配股东的减持行为，在信息披露、持有期限、减持限制等做出了进一步规定，该等规定在防范“违规减持”、“无序减持”等行为，引导和促进价值投资、长期投资，保障资本市场稳定等方面应会发挥积极作用，但短期内一定程度上会限制非公开发行股份解禁后的卖出时间。

《规定》要求上市公司大股东及持有上市公司非公开发行股份的股东，采取集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%，大宗交易受让方在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。其中持有上市公司非公开发行股份的股东通过集中竞价交易减持该部分股份的，自股份解除限售之日起12个月内，还需满足减持数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的50%的规定。

本基金持有的非公开发行股份的减持需严格遵守《规定》要求，敬请投资者注意投资风险。

财通基金管理有限公司

二〇一七年八月二十四日