（上接B109版）

9.2 利润表（转型前）

会计主体：财通保本混合型发起式证券投资基金

本报告期：2015年01月01日至2015年12月24日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年01月01日至2015年12月24日	上年度可比期间 2014年01月01日至2014年12月31日
一、收入		25,893,697.69	35,970,077.87
1.利息收入		8,975,121.87	17,418,193.04
其中：存款利息收入		113,431.92	94,098.62
债券利息收入		8,347,295.12	16,995,027.35
资产支持证券利息收入		493,939.74	208,657.53
买入返售金融资产收入		20,455.09	120,409.54
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		19,476,125.99	7,324,216.95
其中：股票投资收益		11,518,964.15	4,320,877.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益		7,778,113.80	2,974,688.03
资产支持证券投资收益		136,612.32	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		42,435.72	28,651.91
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-2,865,582.49	10,804,743.84
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		308,032.32	422,924.04
减：二、费用		5,031,394.25	8,360,569.54
1.管理人报酬		1,930,050.92	2,774,677.48
2.托管费		321,675.16	462,446.25
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		1,630,745.40	576,524.12
5.利息支出		767,964.58	4,167,838.69
其中：卖出回购金融资产支出		767,964.58	4,167,838.69
6.其他费用		380,958.19	379,083.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		20,862,303.44	27,609,508.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		20,862,303.44	27,609,508.33

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

9.3 所有者权益（基金净值）变动表（转型前）

会计主体：财通保本混合型发起式证券投资基金

本报告期：2015年01月01日至2015年12月24日

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日至2015年12月24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)	170,190,654.26	18,510,541.99	188,701,196.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,862,303.44	20,862,303.44
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)	-49,263,896.36	-8,894,430.80	-58,158,327.16
其中：1.基金申购款	85,557,523.64	22,414,499.75	107,972,023.39
2.基金赎回款	-134,821,420.00	-31,308,930.55	-166,130,350.55
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)	120,926,757.90	30,478,414.63	151,405,172.53

项目	上年度可比期间 2014年01月01日至2014年12月31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)	272,291,571.00	-3,513,561.61	268,778,009.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,609,508.33	27,609,508.33
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)	-102,100,916.74	-5,585,404.73	-107,686,321.47
其中：1.基金申购款	5,168,006.97	483,865.60	5,651,872.57
2.基金赎回款	-107,268,923.71	-6,069,270.33	-113,338,194.04
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)	170,190,654.26	18,510,541.99	188,701,196.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告9.1至9.4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

9.4 报表附注（转型前）

9.4.1 基金基本情况

财通保本混合型发起式证券投资基金（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[2012]1481号文《关于核准财通保本混合型发起式证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人财通基金管理有限公司于2012年11月19日至2012年12月14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(2012)验字第60951782_B10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2012年12月20日生效。本基金为契约型开放式，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346,471,828.76元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币70,097.87元，以上实收基金（本息）合计为人民币346,541,926.63元，折合346,541,926.63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，注册登记机构为财通基金管理有限公司，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具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券（包含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、资产支持债券、可转换债券、分离交易可转换债券、债券回购等）、货币市场工具、权证、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的相关规定）。如法律法规或中国证监会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。本基金的投资组合比例有如下限制：股票、权证等权益类资产占基金资产的比例不超过40%；债券、货币市场工具、现金及其它资产的比例合计不低于基金资产的60%，其中基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%；权证的投资比例不得超过基金资产净值的3%。如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金业绩比较基准：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。

9.4.2 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。

9.4.3 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2015年12月31日的财务状况以及2015年1月1日至2015年12月24日的经营成果和净值变动情况等有关信息。

9.4.4 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

除本报告"9.4.5.2 会计估计变更的说明"中的变更外，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。

9.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

9.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

9.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期根据中国证券投资基金业协会《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知）（中基协发〔2014〕24号）的规定，本基金管理人自2015年3月27日起对本基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。于2015年3月27日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

9.4.5.3 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。

9.4.6 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、国家税务总局财税字[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、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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、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、国家税务总局财税字[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、国家税务总局财税字[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。

9.4.7 关联方关系

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、注册登记机构、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
杭州市实业投资集团有限公司	基金管理人的股东
浙江升华拜克生物股份有限公司	基金管理人的股东
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
上海财通资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

9.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

9.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

9.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月24日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
财通证券	12,647,613.47	1.08%	20,629,777.25	5.00%

9.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月24日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
财通证券	160,887,440.64	60.66%	190,631,704.15	41.92%

9.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月24日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	6,000,000.00	0.27%	1,042,700,000.00	18.82%

9.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

9.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月24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	11,429.20	1.25%	0.00	0.00%

关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	18,380.00	5.59%	920.15	0.37%

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。

9.4.8.2 关联方报酬

9.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日至2015年12月24日	上年度可比期间 2014年01月01日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,930,050.92	2,774,677.48
其中：支付销售机构的客户维护费	1,026,089.53	1,542,063.03

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1.2%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 × 1.2% / 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。

9.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年01月01日至2015年12月24日	上年度可比期间 2014年01月01日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	321,675.16	462,446.25

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0.2%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 × 0.2% / 当年天数。

9.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

9.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

9.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

9.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2014年12月24日		上年度末 2014年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
财通证券股份有限公司	9,999,200.00	8.27%	9,999,200.00	5.88%

注：财通证券股份有限公司（"财通证券"）于认购期内运用固有资金10,000,000.00元认购本基金份额9,999,200.00份，其中募集期间产生的利息为200元，折合200份基金份额，认购手续费1000元。截至报告日，发起资金的持有期限已满足法律法规及基金合同的规定。

9.4.8.5 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 2015年01月01日至2015年12月24日		上年度可比期间 2014年01月01日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行活期存款	140,299,540.29	91,118.03	2,250,975.05	45,207.45

注：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。

9.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

9.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项的说明。

9.4.9 期末（2015年12月24日）本基金持有的流通受限证券

9.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发的流通受限证券。

9.4.9.2 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(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额
600699	均胜电子	2015-11-04	重大资产重组	31.25	2016-03-10	29.00	280,000	9,291,995.00	8,750,000.00

9.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

9.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因债券回购交易作为抵押的债券。

9.4. 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。

9.4.10 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2015年12月24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二层次的余额为人民币18,840,678.60元，无属于第一层次、第三层次的余额。

于2014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88,191,914.11元，属于第二层次的余额为人民币95,638,594.00元，无属于第三层次的余额。

(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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知）的规定，自2015年3月27日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。

(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末发生变动。

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。

§10 投资组合报告(财通收益增强债券型证券投资基金)

转型后：财通收益增强债券型证券投资基金

报告期（2015年12月25日－2015年12月31日）

10.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	8,750,000.00	5.96
	其中：股票	8,750,000.00	5.96
2	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	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	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	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	11,168,136.96	7.61
7	其他各项资产	948,771.36	0.65
8	合计	146,793,806.72	100.00

10.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

10.2.1 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	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

10.2.2 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。

10.3 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	600699	均胜电子	280,000	8,750,000.00	6.00

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年度报告正文。

10.4 报告期内股票投资组合的重大变动

10.4.1 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

本基金本报告期内未买入股票。

10.4.2 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

本基金本报告期内未卖出股票。

10.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未买卖股票。

10.5 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	-	-
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

10.6 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	124832	14蔺宁润	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

10.7 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。

10.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

10.9 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。

10.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

10.10.1 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。

10.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金不投资股指期货。

10.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.11.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

10.11.2 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。

10.11.3 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。

10.12 投资组合报告附注

10.12.1 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

10.12.2 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

10.12.3 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	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

10.12.4 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。

10.12.5 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(元)	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	重大资产重组

10.12.6 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。

§11 投资组合报告(财通保本混合型发起式证券投资基金)

转型前：财通保本混合型发起式证券投资基金

报告期（2015年01月01日－2015年12月24日）

11.1 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	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	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	-	-
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	142,720,834.32	88.13
7	其他各项资产	386,498.86	0.24
8	合计	161,948,011.78	100.00

11.2 报告期末（2015年12月24日）按行业分类的股票投资组合

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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	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

11.2.2 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。

11.3 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

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	600699	均胜电子	280,000	8,750,000.00	5.78

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年度报告正文。

11.4 报告期内股票投资组合的重大变动

11.4.1 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	000523	广州浪奇	35,683,680.85	18.91
2	002698	博实股份	25,877,569.24	13.71
3	300096	易联众	17,843,164.00	9.46
4	002488	金固股份	16,227,525.90	8.60
5	000410	沈阳机床	13,554,031.00	7.18
6	600662	强生控股	12,159,938.00	6.44
7	000752	西藏发展	11,943,782.89	6.33
8	300248	新开普	11,690,151.40	6.20
9	600655	豫园商城	11,440,029.00	6.06
10	600493	凤竹纺织	10,774,124.93	5.71
11	300226	上海钢联	10,190,925.40	5.40
12	300170	汉得信息	10,124,829.29	5.37
13	002363	隆基机械	10,089,817.60	5.35
14	600058	五矿发展	9,828,325.86	5.21
15	600699	均胜电子	9,291,995.00	4.92
16	601628	中国人寿	8,706,780.59	4.61
17	300053	欧比特	8,601,034.00	4.56
18	000686	东北证券	8,540,330.00	4.53
19	600836	界龙实业	8,493,672.05	4.50
20	600767	运盛医疗	8,135,597.47	4.31
21	300367	东方网力	8,007,924.00	4.24
22	300114	中航电测	7,989,443.00	4.23
23	600687	刚泰控股	7,790,581.65	4.13
24	300413	快乐购	7,549,078.00	4.00
25	000567	海德股份	7,477,720.00	3.96
26	002023	海特高新	7,108,083.34	3.77
27	300205	天喻信息	7,099,367.30	3.76
28	000559	万向钱潮	7,038,578.93	3.73
29	000969	安泰科技	6,935,078.78	3.68
30	002576	通达动力	6,754,775.50	3.58
31	600055	华润万东	6,717,020.00	3.56
32	002493	荣盛石化	6,550,597.00	3.47
33	600125	铁龙物流	6,525,376.59	3.46
34	002339	积成电子	6,516,453.00	3.45
35	002609	捷顺科技	6,291,799.82	3.33
36	601166	兴业银行	6,030,000.00	3.20
37	002666	德联集团	5,645,289.52	2.99
38	601318	中国平安	5,440,550.00	2.88
39	300004	南风股份	5,422,765.40	2.87
40	600108	亚盛集团	4,752,000.00	2.52
41	002312	三泰控股	4,742,000.00	2.51
42	600195	中牧股份	4,570,597.84	2.42
43	000050	深天马A	4,480,792.83	2.37
44	002055	得润电子	4,480,339.00	2.37
45	601688	华泰证券	4,469,157.50	2.37
46	002285	世联行	4,447,396.00	2.36
47	600705	中航资本	4,424,560.00	2.34
48	601766	中国中车	4,421,117.00	2.34
49	600109	国金证券	4,401,159.50	2.33
50	000925	众合科技	4,304,505.00	2.28
51	002322	理工监测	4,297,917.00	2.28
52	600805	悦达投资	4,138,557.00	2.19
53	000801	四川九洲	4,116,494.40	2.18
54	002362	汉王科技	4,078,525.00	2.16
55	600844	丹化科技	4,075,028.00	2.16
56	002176	江特电机	4,065,416.71	2.15
57	000638	万方发展	4,050,809.68	2.15
58	002282	博深工具	4,050,551.05	2.15
59	601601	中国太保	4,035,069.00	2.14
60	600775	南京熊猫	4,025,379.00	2.13
61	000619	海螺型材	3,960,721.50	2.10
62	600360	华微电子	3,930,878.33	2.08

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。

11.4.2 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	000523	广州浪奇	38,867,524.69	20.60
2