东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

基金管理人:东兴证券股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22日

§1 重要提示

1.1 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。
基金托管人中国农业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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2016年1月1日起至2016年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东兴改革精选混合
基金主代码	001708
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月8日
报告期末基金份额总额	97,839,786.95份
投资目标	本基金主要投资受益于全面深化改革的行业股票,精选其中具有竞争优势和估值优势的上市公司,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金以中国全面深化改革过程中产生的各类投资机遇作为主线,并通过"自上而下"和"自下而上"相结合的方法构建基金资产组合。一方面,本基金在对国内外宏观经济发展趋势、相关改革政策深入研究的基础上,从"自上而下"的角度对大类资产进行优化配置,并优选受益行业;另一方面,本基金从商业模式、市场前景、竞争壁垒、财务状况等方面出发,"自下而上"精选受益改革相关证券中具有竞争优势和估值优势的优质上市公司,力求在严格控制风险的前提下,获取长期持续稳健的投资收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中高风险水平的投资品种。
基金管理人	东兴证券股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日-2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-12,651,334.27
2.本期利润	-20,835,016.55
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2043
4.期末基金资产净值	87,762,349.91
5.期末基金份额净值	0.897

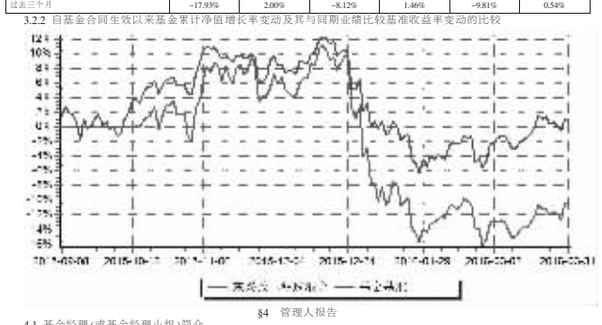
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-17.93%	2.00%	-8.12%	1.46%	-9.81%	0.54%

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



§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		
孙继青先生	本基金基金经理	2015年9月8日	-	8年	北京科技大学工学硕士,3年钢铁行业经验,7年证券行业经验.2007年10月加入东兴证券,2007年10月至2012年3月任东兴证券研究所钢铁行业研究员;2012年3月至2013年6月任东兴证券资产管理部投资品行业研究员,宏观策略研究员;2013年6月至2014年9月任东兴证券资产管理部投资经理.2014年9月加入东兴证券基金业务部,现任东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理.东兴监商财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
刘家伟先生	本基金基金经理	2015年12月25日	-	18年	经济学博士,从事证券行业18年以上,曾任大通证券研发中心副总经理.2007年入职东兴证券股份有限公司研究所,从事家方研究,曾任造纸、农业、食品饮料行业分析师,历任食品饮料首席分析师,消费组组长,研究所副所长,研究总监等.现任职基金业务部投资研究团队,现任东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理.东兴监商财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:1.对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
2.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》等有关法律法规、中国证券监督管理委员会和《东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。
本报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

年初市场担心经济继续下行,人民币贬值、美国加息,同时大股东减持预期再加上交易制度限制下,市场出现了恐慌性下跌,但春节之后,特别是两会之后,房地产市场成交活跃、经济复苏预期变好、货币财政政策宽松、美国加息预期延后、人民币贬值预期缓解等,市场出现了一波反弹.报告期内,上证综指、沪深300和创业板指数涨幅分别为-15.12%、-13.75%和-17.53%。

报告期内,特别是年初的快速下跌超出了市场预期,本基金净值也跟随市场出现了快速下跌。在市场调整时机布局了医药和消费等抗跌品种,两会之后市场反弹,抓住市场反弹的良机,基金净值开始逐步上涨,但反弹力度稍弱于市场。整个一季度配置中主要以消费为主,少量配置了金融和军工。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2016年1月1日起至2016年3月31日,本基金份额净值增长率为-17.93%,业绩比较基准收益率为-8.12%,低于业绩比较基准9.81%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日出现基金持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年二季度,中国经济在房地产投资加速预期下,呈现弱复苏的格局,经济复苏延续时间主要看房地产的投资能否持续。

从政策层面来看,供给侧改革仍然是主旋律,但经济复苏情况下大宗商品价格上涨可能会延缓过剩产能退出,由于美国进入加息周期,同时国内通胀预期升温,市场担心货币政策有可能转向。总体来讲,市场经历了一波反弹之后,估值再次高企,市场仍面临较大的不确定性,但我们认为,国企改革和供给侧改革仍然是市场的热点,大众创业万众创新所带来的新的经济增长点仍然有较大的投资机会,受益于通胀的品种也值得关注。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	63,783,800.00	71.99
	其中:股票	63,783,800.00	71.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,005,000.00	11.29
	其中:债券	10,005,000.00	11.29
	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	14,151,486.70	15.97
8	其他资产	663,584.85	0.75
9	合计	88,603,871.55	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,593,000.00	1.82
C	制造业	36,383,900.00	41.46
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	2,128,600.00	2.43
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	6,576,300.00	7.49
J	金融业	12,792,000.00	14.58
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,310,000.00	4.91
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	63,783,800.00	72.68

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600085	同仁堂	160,000	4,827,200.00	5.50
2	000796	凯撒旅游	200,000	4,310,000.00	4.91
3	002675	东诚药业	100,000	4,286,000.00	4.88
4	600030	中信证券	200,000	3,560,000.00	4.06
5	002142	宁波银行	250,000	3,367,500.00	3.84
6	600276	恒瑞医药	70,000	3,306,100.00	3.77
7	002179	中航光电	90,000	3,217,500.00	3.67
8	601318	中国平安	100,000	3,181,000.00	3.62
9	300059	东方财富	70,000	3,101,000.00	3.53
10	600038	中直股份	70,000	3,046,400.00	3.47

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	10,005,000.00	11.40
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	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,005,000.00	11.40

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019509	15国债09	100,000	10,005,000.00	11.40
2				-	0.00
3				-	0.00
4				-	0.00
5				-	0.00

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

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1
本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。

5.11.2
本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	418,412.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	242,216.48
5	应收申购款	2,955.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	663,584.85

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000796	凯撒旅游	4,310,000.00	4.91	重大资产重组停牌
2	002675	东诚药业	4,286,000.00	4.88	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期初基金份额总额	107,288,483.26
报告期间基金总申购份额	2,095,186.11
减:报告期间基金总赎回份额	11,543,882.42
报告期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	97,839,786.95

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期初管理人持有的本基金份额	17,999,000.00
报告期间买入/申购总份额	-
报告期间卖出/赎回总份额	-
报告期末管理人持有的本基金份额	17,999,000.00
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	18.40

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1.东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同
2.东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议
3.东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金2016年1季度报告原文

8.2 存放地点
北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦12层

8.3 查阅方式
投资者可免费查阅,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件,投资者还可在本基金管理人网站(www.fund.dxzq.net)查阅。

东兴证券股份有限公司
二〇一六年四月二十二日

中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数增强型证券投资基金

2016 第一季度 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:上海银行股份有限公司
报告送出日期:2016年04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。
基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4月21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。
本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中证财通可持续发展100指数
场内简称	-
基金主代码	000042
交易代码	-
基金运作方式	契约型,开放式
基金合同生效日	2013年03月22日
报告期末基金份额总额	17,709,755.12份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金,在力求对中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数进行有效跟踪的基础上,通过基于数量化的多策略系统进行收益增强和风险控制,力争实现超越该指数的收益率水平。 本基金对业绩比较基准的跟踪目标是:力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差不超过7.75%。
投资策略	本基金采取"指数化投资为主、主动性投资为辅"的投资策略,力求在控制标的指数跟踪误差的基础上,适当采用量化增强策略获取超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
基金管理人	财通基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年01月01日-2016年03月31日)
1.本期已实现收益	-3,452,185.39
2.本期利润	-3,786,086.75
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1973
4.期末基金资产净值	23,878,699.85
5.期末基金份额净值	1.348

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。

3.2 基金净值表现

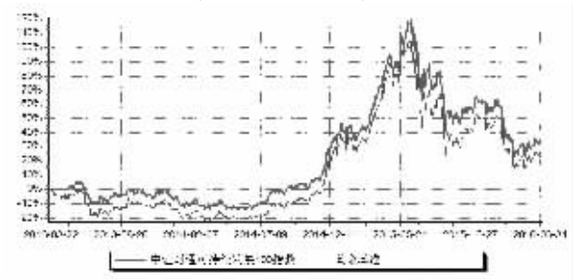
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-14.30%	2.36%	-13.54%	2.43%	-0.76%	-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)本基金的业绩比较基准为,中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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

中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数增强型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年03月22日-2016年03月31日)



注:(1)本基金合同生效日为2013年3月22日;
(2)本基金投资于中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数成份股和备选成份股的资产占基金资产净值;≥80%;投资于权证的资产占基金资产净值;≤3%;现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值;≥5%。本基金的建仓期为2013年3月22日至2013年9月22日;截至建仓期末及本报告期末,基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
焦庆	本基金的基金经理	2015年04月03日	-	8年	哈尔滨工业大学管理学博士,历任深圳飞亚达集团华东区域经理,市场部副总经理,西部证券资产管理部研究员,天治基金高级研究员,上海泽熙投资高级研究员,历任财通基金管理有限公司研究部总监助理、副总监、投资经理。

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 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投权体系,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,确保在均内、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。

本报告期内,本基金立足于被动投资,尽量控制基金份额净值与标的指数的跟踪误差,主动增强配置在位较低。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2016年1季度,本基金净值增长率为-14.30%,业绩比较基准增长率为-13.54%,跑输业绩比较基准0.76%。目或立以来,本基金一直坚持被动跟踪,量化增强的投资策略,在密切跟踪标的指数的基础上努力争取获得超额收益。

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人的情况出现;本基金资产净值于2015年11月11日至2016年2月2日期间连续59个工作日低于5000万元,并于2016年2月3日恢复至5000万元以上,于2016年2月5日再次低于5000万元,截至报告期末,已持续35个交易日,本基金管理人将持续关注本基金资产净值情况,并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2季度,工业品补库存周期有望延续,经济仍将运行在"弱复苏"轨道,CPI或稳中有升,但核心CPI仍然稳定,全局性通胀还比较遥远,考虑到全球经济增长乏力,美联储加息幅度及节奏不会强烈,新兴经济体出现"危机模式"是小概率事件,但仍需密切关注人民币汇率变化对市场情绪的影响,无风险利率预计维持当前水平,对市场影响偏中性,投资者激进及股东解禁导致二级市场资金面不容乐观,指数上行存在"天花板"。

我们将坚持价值投资,立足可持续发展,并通过指数增强,为持有人实现良好的投资回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	22,277,718.30	91.75
	其中:股票	22,277,718.30	91.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	1,943,446.52	8.00
8	其他资产	59,992.64	0.25
9	合计	24,281,157.46	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
5.2.1.1 报告期末(指数投资)按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,585,554.69	6.64
C	制造业	8,892,586.24	37.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,084,727.51	4.54
E	建筑业	1,923,788.92	8.06
F	批发和零售业	227,938.60	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	1,809,805.38	7.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	569,640.11	2.39
J	金融业	4,508,178.75	18.88
K	房地产业	1,284,824.56	5.38
L	租赁和商务服务业	390,673.54	1.64
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	22,277,718.30	93.30

5.2.1.2 报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未有积极投资股票。

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	000002	万 科A	18,658	455,814.94	1.91
2	600519	贵州茅台	1,169	289,491.16	1.21
3	600188	兖州煤业	27,036	287,122.32	1.20
4	600741	华域汽车	18,612	283,274.64	1.19
5	600688	上海石化	40,831	278,467.42	1.17
6	000625	长安汽车	16,551	261,009.27	1.09
7	000046	泛海控股	24,000	259,440.00	1.09
8	000895	双汇发展	12,278	259,188.58	1.09
9	000858	五粮液	9,209	258,864.99	1.08
10	000937	冀中能源	48,338	254,741.26	1.07

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
本基金本报告期末未有积极投资股票。

5.4 报告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有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。

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

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率,更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

5.10 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。

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。

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	59,389.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	504.22
5	应收申购款	99.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	59,992.64

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	17,829,317.70
报告期期间基金总申购份额	22,943,899.67
减:报告期期间基金总赎回份额	23,063,462.25
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	17,709,755.12

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2015年07月08日	1,828,670.63	3,000,000.00	0.40%
合计			1,828,670.63	3,000,000.00	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

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

1.2016年1月4日披露了《关于财通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与中国工商银行2016倾心回馈基金定投费率优惠活动的公告》;
2.2016年1月4日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下基金2015年年度资产净值的公告》;
3.2016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》;
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》;
6.2016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》;
7.2016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》;
8.2016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》;
9.2016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》;
10.2016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》;
11.2016年1月20日披露了《财通收益增强债券型证券投资基金2015年第4季度报告》;
12.2016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》;
13.2016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》;
14.2016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》;
15.2016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》;
16.2016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金枫动力股份有限公司情况的公告》;
17.2016年3月3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》;
18.2016年3月17日披露了《关于财通基金管理有限公司增加上海朝阳永续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》;
19.2016年3月17日披露了《财通收益增强债券型证券投资基金(原"财通保本混合型发起式证券投资基金")更新招募说明书(2015年第2号)》及其摘要;
20.2016年3月23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》;
21.2016年3月26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》;
22.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.关于中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数增强型证券投资基金基金合同;
3.关于中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数增强型证券投资基金基金托管协议;
4.关于中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数增强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

财通收益增强债券型证券投资基金

2016 第一季度 报告

2016年3月31日

**基金管