

财通价值动量混合型证券投资基金

2013 第四季度 报告

2013年 12 月 31 日

A.2 报告期末按行业分类的投资组合		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	10,628,694.43	18.10
D	电力、热力、燃气及生产供水业	264,750.00	0.45
E	建筑业	3,990,541.02	6.79
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	8,348,315.93	14.52
K	房地产业	9,407,188.00	16.22
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	332,279.50	0.58
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	32,863,868.63	56.13

A.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证券投资明细				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
1	600016	民生银行	400,661	3,787,907.92

2	002524	光生通信	570,000	3,180,660,000	542
3	000002	万科A	330,526	2,654,123,778	452
4	600048	保利地产	314,366	2,593,519,500	442
5	600036	招商银行	219,171	2,386,772,119	406
6	601633	长城汽车	55,488	2,284,440,996	389
7	601166	兴业银行	214,363	2,173,640,832	370
8	002146	爱康齿科	212,285	2,122,850,000	361
9	600418	江淮汽车	157,174	1,372,120,002	234
10	600597	光明乳业	60,744	1,348,516,800	230

注：本基金持有以上非公开发行股票全部为公司公开发行的流通股受限股票。



本基金本报告期末未持有股指期货合约。

5.1.2 本基金未投资股指期货中的投机交易

本基金暂不投资股指期货。

5.1.3 报告期末本基金投资的国债期货持仓及交易情况说明

5.1.1 本期国债期货持仓情况

本基金未投资国债期货。

5.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和限制明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.3 本期国债期货投资情况

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.4 投资组合合规性说明

根据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,或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.5 报告期末,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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额	单位:人民币元
1	存在保证金	50,951.17	
2	应收证券清算款	20,873,432.32	
3	应收股利	—	
4	应收利息	34,881.16	
5	应收资产减值	197.63	
6	其他应收款	—	
7	待摊费用	—	
8	其他	—	
9	合计	20,959,462.28	

5.10.4 报告期末持有的处于转股期中的可转债余额

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)	金额单位:人民币元
1	113001	中行转债	4,816,500.00	8.20	

5.10.5 报告期末前十名股票中存在未转股情况的说明

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(%)	占基金资产净值比例(%)	金额单位:人民币元
1	000524	紫光国微	3,140,600.00	5.42	流通股受限股	

5.10.6 报告期末持有的其他大额资产类别

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误差。

5.6 开放式基金资产变动

	单位:元
本报告期初的基金资产总额	74,901,320.34
本报告期间基金总申购份额	1,137,652.07
本报告期间基金总赎回份额	19,133,786.52
本报告期间基金净申购份额	—
本报告期末基金资产总额	56,905,183.89

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

8 影响投资决策的其他重要信息

为便于投资者,公司根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定,在《中国证报》、《上海证券报》、《证券时报》及管理人网站和“巨潮资讯网”披露如下:

1. 2019年12月1日披露了《财信价值量化混合型证券投资基金2019年第4季度报告》;
2. 2019年12月7日披露了《财信基金管理有限责任公司关于开展风险管控追偿基金追金增值 高亮发行引发违法违规的澄清公告》;
3. 2019年12月16日披露了《财信基金管理有限责任公司关于外聘人、浦惠合管理合伙企业(有限合伙)被中国证监会立案调查并予以行政处罚的公告》;
4. 2019年12月16日披露了《财信基金管理有限责任公司关于通过公开方式召开基金份额持有人大会的议案》;
5. 2019年12月16日披露了《财信基金管理有限责任公司关于调整基金一类别内主理基金经理从任职最低年限的公告》;
6. 利率市场化,公司股票(包括可转债)的价格可能会与公司基本估值存在较大金额的价差计算。

9 备查文件目录

1. 中国证监会核准募集的文件;
2. 财信价值量化混合证券投资基金合同;
3. 财信价值量化混合证券投资基金招募说明书;
4. 财信价值量化混合证券投资基金基金托管协议;
5. 财信价值量化混合证券投资基金基金销售协议;
6. 基金管理人业务资格批复、营业执照;
7. 基金托管人业务资格批复、营业执照;
8. 报告期内披露的各项公告;
9. 其他规定

上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心41楼。
 查阅方式:
 投资者可以到基金管理人或基金人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付了工本费后,投资者也可在合理时间内获得制备文件的复印件并支付费用。
 投资者对相关内容如有疑问,可与基金管理人联系。
 咨询电话: 800-820-9888
 公司网址: <http://www.cftfund.com>

财信基金管理有限公司

本基金投资于国内依法发行和上市的交易证券。

7、周持仓比例及公允价值占基金净资产比例均大于一半的 five 只股权投资明细

本基金本期尚未持有有价证券。

8、回顾期末本基金投资的股指期货交易情况说明

S8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓合约及损益说明

本基金本报告期末未有股指期货持仓合约。

S8.2 本基金投资股指期货的投资策略

基金管理人可运用股指期货，以提高投资组合效率，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，低风险的方式进行操作，本决策将参照：参与股指期货投资的目的，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，本基金还将根据法律法规的要求对基金资产净值波动率、仓位分布等特殊情况下的波动风险进行更有效的风险管理。

2013 第四季度 报告

S.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓合约期限明细

本基金全国暂未持有国债期货。

S.9.3 本期国债期货投资情况

本基金全国报告期内未有国债期货。

S.9.4 投资组合报告附注

S.9.4.1 报告期内，本基金投资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、处罚的情况

S.9.4.2 报告期内，本基金投资的前十名证券中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

S.9.4.3 房地产资产构成

		单位：人民币元
序号	名称	金额
1	存出保证金款	112,908.18
2	应收证券清算款	144,643.66
3	应收账款	-
4	预付账款	962.90
5	应收申购款	2,277.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	287,992.16

S.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金全国报告期内未持有处于转股期的可转换债券。

S.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

S.10.5.1 报告期末投资前十名股票中有因流通股受限而导致的说明

本基金全国报告期内无投资前十名股票不存在流通股受限的情况。

S.10.5.2 限售和流通受限前十名股票中有因流通股受限而导致的说明

本基金全国报告期内无投资前十名股票存在流通股受限的情况。

S.10.6 投资组合报告附注的其他文本描述部分

截至报告期末/报告期内,本基金资产净值/报告期内基金份额净值的变动情况		单位:元
本报告期期初基金份额总额		76,122,133.20
本报告期基金份额申购/赎回		128,240.32
本报告期基金份额净变动额		9,996,472.28
本报告期末基金份额总额		87,350,745.80
本报告期基金份额净值		66.31750134

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人运用固有资金投资本基金:

§8 影响投资决策的其他重要信息

本报告期间,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》、《证券时报》及管理人网站进行了如下信息披露:

1. 2013年10月12日披露了《中国财通中证中国可持续发展100指数证券投资基金2013年第3季度报告》;

2. 2013年12月1日披露了《中国财通中证中国可持续发展100(ESG)指数证券投资基金更新招募说明书(2013年第1号)》及其他相关信息;

3. 2013年11月12日披露了《财通基金管理有限公司关于“群发函披露证券投资基金净值” 催告资产方“发现违规”的澄清公告》;

4. 2013年12月12日披露了《财通基金管理有限公司关于“内网漏洞”的澄清公告》及《财通基金管理有限公司关于“基金净值”的澄清公告》;

5. 2013年12月18日披露了《财通基金管理有限公司关于“中国沪深300指数证券投资基金(LOF)”基金净值以申购赎回款为基准的公告》;

6. 2013年12月18日披露了《财通基金管理有限公司关于“沪深300指数证券投资基金(LOF)”基金净值以申购赎回款为基准的公告》;

8. 在封闭期内,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。

8.9 基金资产清算

9.1 基金文件目录

1. 中国证监会核准基金募集的文件;
2. 关于《中证沪深国债市场开发(ROBCEPI ESG)指数数据增值服务投资基金基金合同》;
3. 关于《中证沪深国债市场开发(ROBCEPI ESG)指数数据增值服务投资基金基金托管协议》;
4. 关于《中证沪深国债市场开发(ROBCEPI ESG)指数数据增值服务投资基金基金运行风险控制协议》;
5. 基金管理人业务资格批文、营业执照;
6. 基金管理人业务资格批文、营业执照;
7. 受托资产托管的各家公司;
8. 存放地目录

上海市浦东新区国城路68号时代金融中心41楼。

9.2 联系方式

投资者到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅基金文件,在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得基金文件的复制件或复印件。

投资者对本文如有任何疑问,可咨询本管理人。

咨询电话:400-520-9888

公司网址: <http://www.cmfid.com>

财通基金管理有限公司