财通价值动量混合型证券投资基金

【2013】第一季度报告

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
报告送出日期:2013年4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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月17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2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	财通价值动量混合
基金主代码	720001
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2011年12月1日
报告期末基金份额总额	163,380,890.93
投资目标	本基金以价值投资为基础,辅以对市场运行规律的研判,动态调整投资组合,在严格控制风险并充分保证流动性的前提下,力求获取超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	本基金的资产配置策略为以评估不同投资品种的整体投资价值进行战略资产配置,以动量特征为依据进行战术资产配置;个股投资策略充分贯彻"价值投资为基础,动量策略为辅助"的投资理念,分别在行业配置和个股精选两个层面进行基本面情况、估值以及动量效应的研究,挖掘出具有估值优势和动量效应的个股并构建股票投资组合;通过综合运用久期管理策略、收益率曲线策略、类属配置策略、套利和时机选择策略等组合管理手段进行固定收益证券投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60% + 上证国债指数收益率×40%。
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、中高预期收益的基金产品。
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

§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(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	20,685,343.39
2.本期利润	12,326,785.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.0659
4.期末基金资产净值	171,136,986.66
5.期末基金份额净值	1.047

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

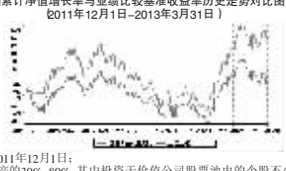
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.76%	1.17%	-0.16%	0.93%	5.92%	0.24%

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本基金选择沪深300指数作为股票投资部分的业绩基准,选择上证国债指数作为债券投资部分的业绩基准,复合业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

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

财通价值动量混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011年12月1日-2013年3月31日)



注:①本基金合同生效日为2011年12月1日;

②本基金股票资产占基金资产的30%-80%,其中投资于价值公司股票池内的个股不少于股票资产的80%;债券、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的0%-65%,其中权证资产占基金资产净值的比例为0%-3%;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%。本基金的建仓期是2011年12月1日至2012年12月1日,截至建仓期末和本报告期末,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		
吴松凯	本基金的基金经理、公司基金投资部副总监	2011年12月1日	-	6年	英国杜伦大学金融与投资硕士,CFA,FRM。历任工商银行深圳分行投资银行部投行财务顾问、招商银行总行计财部市场风险计量与管理主管、华泰联合证券研究所银行业首席研究员。

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》、《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、事中和事后三个环节,每月的投资风险报告针对旗下所有组合的所有交易记录进行了交易时机和价差的专项统计分析,并经过严格的报告和审批程序,防范和控制异常交易。

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,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平或涉嫌异常交易的情况。

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,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:

1.2013年1月4日披露了《财通价值动量混合型证券投资基金2012年年度资产净值的公告》;
2.2013年1月10日披露了《财通基金销售网点及销售人员资格信息一览表》;
3.2013年1月12日披露了《财通价值动量混合型证券投资基金更新招募说明书(2012年第2号)》及其摘要;
4.2013年1月19日披露了《财通价值动量混合型证券投资基金2012年第4季度报告》;
5.2013年2月21日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告》;
6.2013年2月27日披露了《财通价值动量混合型证券投资基金分红公告》;
7.2013年3月8日披露了《关于财通基金增加深圳众禄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》;
8.2013年3月27日披露了《财通价值动量混合型证券投资基金2012年年度报告》及其摘要;
9.2013年3月27日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中国工商银行股份有限公司继续开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告》;
10.2013年3月29日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加上海好买基金销售有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告》;
11.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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1.中国证监会核准基金募集的文件;
2.财通价值动量混合型证券投资基金基金合同;
3.财通价值动量混合型证券投资基金基金托管协议;
4.财通价值动量混合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。

8.2 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。

8.3 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
二〇一三年四月二十二日

财通多策略稳健增长债券型证券投资基金

【2013】第一季度报告

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
报告送出日期:2013年4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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月17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2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	财通多策略稳健增长债券
基金主代码	720002
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2012年7月13日
报告期末基金份额总额	1,233,040,777.04
投资目标	本基金在有效控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争持续稳定地实现超越业绩比较基准的组合收益。
投资策略	本基金主要通过以下两个策略进行资产配置:第一,以广义动态固定比例投资组合保险策略(CPPI,Constant Proportion Portfolio Insurance)为基本策略,动态调整安全资产与风险资产的投资比例,力争在有效控制风险的前提下,实现稳健的组合收益;第二,实施时间不变性投资组合保险策略(TIPP,Time Invariant Portfolio Protection),通过定期强制实施收益分配锁定部分阶段收益,不断提高单位运作周期到期时的目标价值。 本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行安全资产的投资,主要投资策略包括债券投资组合策略和动态品种优化策略。 本基金的风险资产投资策略包括基于可转债的收益增强策略、二级市场股票投资策略、新股申购策略及权证投资策略等。
业绩比较基准	每个单位运作周期起始日的3年期银行定期存款税后收益率+0.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期的风险水平和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	财通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	19,806,233.41
2.本期利润	27,368,830.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0174
4.期末基金资产净值	1,250,305,805.30
5.期末基金份额净值	1.014

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

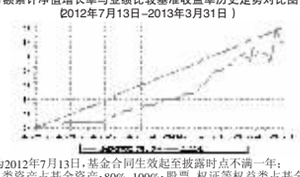
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.69%	0.15%	1.19%	0.02%	0.50%	0.13%

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:每个单位运作周期起始日的3年期银行定期存款税后收益率+0.5%。

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

财通多策略稳健增长债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年7月13日-2013年3月31日)



注:①本基金合同生效日为2012年7月13日,基金合同生效起至披露时点不满一年;

②本基金债券等固定收益类资产占基金资产:80%-100%;股票、权证等权益类占基金资产:0-20%;权证占基金资产:0-3%;现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产:≥5%。本基金建仓期自2012年7月13日起至2013年1月13日,建仓期末和报告期末,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		
曹丽娟	本基金的基金经理	2012年7月13日	-	6年	新加坡国立大学机械工程系博士。历任新加坡大华银行风险管理部门助理经理,新加坡渣打银行信用衍生品模型分析员,香港巴克莱银行信用衍生品产品交易设计员、首尔HanaDaeTooSecurities派生商品数量交易主任。

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》、《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、事中和事后三个环节,每月的投资风险报告针对旗下所有组合的所有交易记录进行了交易时机和价差的专项统计分析,并经过严格的报告和审批程序,防范和控制异常交易。

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,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平或涉嫌异常交易的情况。

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,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:

1.2013年1月4日披露了《财通多策略稳健增长债券型证券投资基金2012年年度资产净值的公告》;
2.2013年1月10日披露了《财通基金销售网点及销售人员资格信息一览表》;
3.2013年1月19日披露了《财通多策略稳健增长债券型证券投资基金2012年第4季度报告》;
4.2013年2月21日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告》;
5.2013年2月26日披露了《财通多策略稳健增长债券型证券投资基金更新招募说明书(2013年1号)》及其摘要;
6.2013年3月8日披露了《关于财通基金增加深圳众禄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》;
7.2013年3月12日披露了《财通多策略稳健增长债券型证券投资基金分红公告》;
8.2013年3月27日披露了《财通多策略稳健增长债券型证券投资基金2012年年度报告》及其摘要;
9.2013年3月27日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中国工商银行股份有限公司继续开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告》;
10.2013年3月29日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加上海好买基金销售有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告》;
11.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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1.中国证监会核准基金募集的文件;
2.财通多策略稳健增长债券型证券投资基金基金合同;
3.财通多策略稳健增长债券型证券投资基金基金托管协议;
4.财通多策略稳健增长债券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。

8.2 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。

8.3 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
二〇一三年四月二十二日

财通保本混合型发起式证券投资基金

【2013】第一季度报告

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
报告送出日期:2013年4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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月17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2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	财通保本混合发起
基金主代码	720003
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2012年12月20日
报告期末基金份额总额	334,612,030.36
投资目标	通过灵活运用投资组合保险策略,在保障本金安全的前提下,力争在保本周期内实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金将各类金融工具划分为安全资产和风险资产,其中债券(可转换债券除外)及货币市场工具等属于安全资产,可转换债券、股票、权证等资产属于风险资产。本基金的投资策略分为两个层面,第一个层面,根据固定比例投资组合保险策略(CPPI,Constant Proportion Portfolio Insurance)和时间不变性投资组合保险策略(TIPP,Time Invariant Portfolio Protection),动态调整安全资产与风险资产的投资比例,即资产配置策略;第二个层面,分别针对安全资产和风险资产的投资策略。
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
风险收益特征	本基金为保本混合型产品,属证券投资基金中的低风险收益品种。
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
基金保证人	中海信达担保有限公司

§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(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	-391,258.96
2.本期利润	1,493,057.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0043
4.期末基金资产净值	336,337,618.35
5.期末基金份额净值	1.005

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	0.40%	0.15%	1.07%	0.02%	-0.67%	0.13%

注:①本基金合同生效日为2012年12月20日,基金合同生效起至披露时点不满一年;

②本基金股票、权证等权益类占基金资产:≤40%;债券、货币市场工具、现金及其它资产占基金资产:≥60%,现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产:≥5%;权证占基金资产:≤3%;本基金的建仓期为2012年12月20日至2013年6月20日,截至报告日,本基金尚在建仓期;截至报告期末,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		
赵媛媛	本基金的基金经理	2012年12月20日	-	5年	西南财经大学经济学硕士。历任中安保险投资部权益投资经理,联合证券、国泰君安证券宏观策略研究员,国泰基金策略研究员。2011年加入财通基金管理有限公司研究部任高级宏观策略研究员。
曹丽娟	本基金的基金经理	2012年12月20日	-	6年	新加坡国立大学机械工程系博士。历任新加坡大华银行风险管理部门助理经理,新加坡渣打银行信用衍生品模型分析员,香港巴克莱银行信用衍生品产品交易设计员,首尔HanaDaeTooSecurities派生商品数量交易主任。

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》、《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、事中和事后三个环节,每月的投资风险报告针对旗下所有组合的所有交易记录进行了交易时机和价差的专项统计分析,并经过严格的报告和审批程序,防范和控制异常交易。

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,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平或涉嫌异常交易的情况。

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,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:

1.2013年1月4日披露了《财通保本混合型发起式证券投资基金2012年年度资产净值的公告》;
2.2013年1月10日披露了《财通基金销售网点及销售人员资格信息一览表》;
3.2013年3月8日披露了《关于财通保本混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》;
4.2013年3月16日披露了《关于财通保本混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》;
5.2013年3月29日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加上海好买基金销售有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告》;
6.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.财通保本混合型发起式证券投资基金基金合同;
3.财通保本混合型发起式证券投资基金基金托管协议;
4.财通保本混合型发起式证券投资基金招募说明书;
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
二〇一三年四月二十二日

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	32,528,773.80	19.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,248,875.75	4.82
F	批发和零售业	8,537,915.67	4.99
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	2,632,160.40	1.54
J	金融业	21,752,747.61	12.71
K	房地产业	11,838,969.83	6.92
L	租赁和商务服务业	767,055.59	0.45
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,780,726.21	3.96
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	1,470,268.80	0.86
S	综合	-	-
	合计	94,557,493.66	55.25

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

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	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	869,807	8,384,939.48	4.90
2	600153	建发股份	917,926	6,526,453.86	3.81
3	600276	恒瑞医药	145,885	4,903,194.85	2.87
4	600048	保利地产	383,705	4,404,933.40	2.57
5	601633	长城汽车	133,036	4,318,348.56	2.52
6	002524	光正钢构	375,013	3,843,883.25	2.25
7	600383	金地集团	582,215	3,825,152.55	2.24
8	601166	兴业银行	210,304	3,638,259.20	2.13
9	600000	浦发银行	348,428	3,529,575.64	2.06
10	000651	格力电器	123,378	3,524,909.46	2.06

5.4 报告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	8,476,036.80	4.95
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	13,063,923.20	7.63
8	其他	-	-
9	合计	21,539,960.00	12.59

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	113001	中行转债	120,000	12,220,800.00	7.14
2	010308	03国债(8)	84,490	8,476,036.80	4.95
3	110023	民生转债	7,960	843,123.20	0.49

5.6 报告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。

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

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金暂不投资股指期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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	150,745.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	237,505.93
5	应收申购款	12,189.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	400,441.05

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	12,220,800.00	7.14

5.9.5 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。

5.9.6 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

本报告期期初基金份额总额	211,516,695.86
本报告期基金总申购份额	7,406,240.27
减:本报告期基金总赎回份额	55,542,045.20
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	163,380,890.93

§7 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:

1.2013年1月4日披露了《财通价值动量混合型证券投资基金2012年年度资产净值的公告》;
2.2013年1月10日披露了《财通基金销售网点及销售人员资格信息一览表》;
3.2013年1月12日披露了《财通价值动量混合型证券投资基金更新招募说明书(2012年第2号)》及其摘要;
4.2013年1月19日披露了《财通价值动量混合型证券投资基金2012年第4季度报告》;
5.2013年2月21日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告》;
6.2013年2月27日披露了《财通价值动量混合型证券投资基金分红公告》;
7.2013年3月8日披露了《关于财通基金增加深圳众禄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》;
8.2013年3月27日披露了《财通价值动量混合型证券投资基金2012年年度报告》及其摘要;
9.2013年3月27日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中国工商银行股份有限公司继续开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告》;
10.2013年3月29日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加上海好买基金销售有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告》;
11.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。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1.中国证监会核准基金募集的文件;
2.财通价值动量混合型证券投资基金基金合同;
3.财通价值动量混合型证券投资基金基金托管协议;
4.财通价值动量混合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。

8.2 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。

8.3 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
二〇一三年四月二十二日

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

| 代码