

财通保本混合型发起式证券投资基金

2013 半年度报告摘要

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

| 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  | 000063 | 中兴通讯 | 14,582,658.37 | 4.20           |
| 2  | 600315 | 上海家化 | 10,274,118.40 | 2.96           |
| 3  | 002298 | 鑫龙电器 | 9,943,308.14  | 2.87           |
| 4  | 600016 | 民生银行 | 9,560,805.00  | 2.76           |
| 5  | 300012 | 华测检测 | 8,776,306.77  | 2.52           |
| 6  | 300021 | 光线传媒 | 8,627,497.90  | 2.54           |
| 7  | 601051 | 华测检测 | 8,601,826.90  | 2.48           |
| 9  | 002313 | 日海通讯 | 7,158,400.50  | 2.06           |
| 10 | 002347 | 泰尔重工 | 7,035,895.05  | 2.03           |
| 11 | 600340 | 华鲁幸福 | 6,890,568.29  | 1.99           |
| 12 | 600889 | 南京化纤 | 6,112,171.92  | 1.76           |
| 13 | 300056 | 三维丝  | 6,081,320.71  | 1.75           |
| 14 | 600280 | 南京化纤 | 5,204,250.00  | 1.50           |
| 15 | 600809 | 山西汾酒 | 4,792,971.99  | 1.38           |
| 16 | 300070 | 碧水源  | 4,663,108.99  | 1.34           |
| 17 | 002172 | 澳京科技 | 4,497,119.66  | 1.30           |
| 18 | 600535 | 天士力  | 4,483,068.00  | 1.29           |
| 19 | 300315 | 掌趣科技 | 4,375,107.76  | 1.26           |
| 20 | 601318 | 中国平安 | 4,328,885.04  | 1.25           |

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

| 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  | 000063 | 中兴通讯 | 10,778,233.55 | 4.26           |
| 2  | 000016 | 民生银行 | 10,665,178.55 | 3.08           |
| 3  | 600315 | 上海家化 | 9,775,183.04  | 2.87           |
| 4  | 300021 | 光线传媒 | 9,491,541.97  | 2.74           |
| 5  | 002298 | 鑫龙电器 | 9,439,305.67  | 2.72           |
| 6  | 300012 | 华测检测 | 9,258,819.14  | 2.67           |
| 7  | 300212 | 易华录  | 8,289,562.59  | 2.49           |
| 8  | 300165 | 天海仪器 | 8,373,403.39  | 2.41           |
| 9  | 002347 | 泰尔重工 | 7,218,982.59  | 2.08           |
| 10 | 002313 | 日海通讯 | 6,614,509.47  | 1.91           |
| 11 | 600840 | 华鲁幸福 | 6,235,256.27  | 1.86           |
| 12 | 600889 | 南京化纤 | 5,788,740.18  | 1.67           |
| 13 | 300056 | 三维丝  | 5,670,097.75  | 1.63           |
| 14 | 600280 | 南京化纤 | 5,053,951.07  | 1.46           |
| 15 | 002172 | 澳京科技 | 4,716,624.35  | 1.36           |
| 16 | 600809 | 山西汾酒 | 4,606,576.76  | 1.33           |
| 17 | 300070 | 碧水源  | 4,532,143.84  | 1.31           |
| 18 | 600535 | 天士力  | 4,527,796.75  | 1.31           |
| 19 | 300070 | 碧水源  | 4,337,938.42  | 1.25           |
| 20 | 601318 | 中国平安 | 4,325,435.55  | 1.25           |

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

| 买入股票的成本(成交金额) | 279,575,950.57 |
|---------------|----------------|
| 卖出股票的收入(成交金额) | 272,447,373.60 |

7.5 期末按券种分类的债券投资组合

| 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                           | 19,890,000.00  | 6.52         |
|     | 其中:政策性金融债                      | 19,890,000.00  | 6.52         |
| 4   | 企业债券                           | 91,842,107.41  | 30.09        |
| 5   | 企业短期融资券                        | 149,322,500.00 | 48.92        |
| 6   | 中期票据                           | 20,224,000.00  | 6.63         |
| 7   | 可转换                            | 7,607,578.80   | 2.49         |
| 8   | 其他                             | -              | -            |
|     | 合计                             | 288,886,186.21 | 94.65        |
| 7.6 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 |                | 金额单位:人民币     |

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

| 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  | 041353004 | 13云天付CP001 | 200,000 | 19,936,000.00 | 6.52         |
| 2  | 130201    | 13国开债1     | 200,000 | 19,890,000.00 | 6.53         |
| 3  | 041363008 | 13国开CP001  | 200,000 | 19,864,000.00 | 6.51         |
| 4  | 122819    | 11常债转2     | 150,000 | 15,600,000.00 | 5.11         |
| 5  | 041353001 | 13云天付CP001 | 150,000 | 14,907,000.00 | 4.88         |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五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 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投资。 |
|------------------|

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

|                    |
|--------------------|
| 本基金本报告期末未持有股指期货合约。 |
|--------------------|

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

|                    |
|--------------------|
| 本基金本报告期末未持有国债期货合约。 |
|--------------------|

7.11 投资组合报告附注

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存在保本基金  | 173,291.33   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 3,908,477.50 |
| 5  | 应收申购款   | 296.44       |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 4,082,065.27 |

7.10.1 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码    | 债券名称 | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|------|--------------|--------------|
| 1  | 1130003 | 重工转债 | 7,607,578.80 | 2.49         |

7.10.2 期末持有的处于转股期可转换债券明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|-------------|--------------|
| 1  | 000254 | 光大转债 | 845,500.00   | 0.28         | -           | -            |
| 2  | 200020 | 银证转债 | 1,625,439.00 | 0.53         | -           | -            |

7.10.3 期末基金资产组合构成情况

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存在保本基金  | 173,291.33   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 3,908,477.50 |
| 5  | 应收申购款   | 296.44       |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 4,082,065.27 |

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码    | 债券名称 | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|------|--------------|--------------|
| 1  | 1130003 | 重工转债 | 7,607,578.80 | 2.49         |

7.10.5 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 | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|-------------|--------------|
| 1  | 000254 | 光大转债 | 845,500.00   | 0.28         | -           | -            |
| 2  | 200020 | 银证转债 | 1,625,439.00 | 0.53         | -           | -            |

7.10.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

|                    |
|--------------------|
| 本基金本报告期末未持有股指期货合约。 |
|--------------------|

7.10.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

|                    |
|--------------------|
| 本基金本报告期末未持有国债期货合约。 |
|--------------------|

7.10.8 投资组合报告附注

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存在保本基金  | 173,291.33   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 3,908,477.50 |
| 5  | 应收申购款   | 296.44       |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 4,082,065.27 |

7.10.9 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码    | 债券名称 | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|------|--------------|--------------|
| 1  | 1130003 | 重工转债 | 7,607,578.80 | 2.49         |

7.10.10 期末持有的处于转股期可转换债券明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|-------------|--------------|
| 1  | 000254 | 光大转债 | 845,500.00   | 0.28         | -           | -            |
| 2  | 200020 | 银证转债 | 1,625,439.00 | 0.53         | -           | -            |

7.10.11 期末基金资产组合构成情况

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存在保本基金  | 173,291.33   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 3,908,477.50 |
| 5  | 应收申购款   | 296.44       |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 4,082,065.27 |

7.10.12 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码    | 债券名称 | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|------|--------------|--------------|
| 1  | 1130003 | 重工转债 | 7,607,578.80 | 2.49         |

7.10.13 期末持有的处于转股期可转换债券明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|-------------|--------------|
| 1  | 000254 | 光大转债 | 845,500.00   | 0.28         | -           | -            |
| 2  | 200020 | 银证转债 | 1,625,439.00 | 0.53         | -           | -            |

7.10.14 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

|                    |
|--------------------|
| 本基金本报告期末未持有股指期货合约。 |
|--------------------|

7.10.15 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

|                    |
|--------------------|
| 本基金本报告期末未持有国债期货合约。 |
|--------------------|

7.10.16 投资组合报告附注

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存在保本基金  | 173,291.33   |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 3,908,477.50 |
| 5  | 应收申购款   | 296.44       |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 4,082,065.27 |

7.10.17 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码    | 债券名称 | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|------|--------------|--------------|
| 1  | 1130003 | 重工转债 | 7,607,578.80 | 2.49         |

净值和所有者权益

| 项目         | 本期 2013年6月30日  | 上年度末 2012年12月31日 |
|------------|----------------|------------------|
| 净值         | -              | -                |
| 负债         | -              | -                |
| 所有者权益      | -              | -                |
| 交易性金融负债    | -              | -                |
| 衍生金融负债     | -              | -                |
| 应付短期融资款    | -              | -                |
| 应付账款       | 60,000,000.00  | -                |
| 应付利息       | 7,012,629.09   | -                |
| 应付股利       | 222,015.49     | -                |
| 应付管理人报酬    | 304,396.92     | 125,026.70       |
| 应付托管费      | 50,732.81      | 20,837.79        |
| 应付销售服务费    | -              | -                |
| 应付交易费用     | 163,364.82     | -                |
| 应交税费       | 89,269.95      | -                |
| 应付利息       | -              | -                |
| 应付利润       | -              | -                |
| 递延所得税负债    | -              | -                |
| 其他综合收益     | -              | -                |
| 负债合计       | 68,034,325.75  | 175,864.49       |
| 所有者权益      | -              | -                |
| 实收资本       | 307,148,737.46 | 346,541,926.63   |
| 未分配利润      | -1,923,151.47  | 294,903.70       |
| 所有者权益合计    | 305,225,585.99 | 346,836,830.33   |
| 负债和所有者权益总计 | 373,259,911.74 | 347,042,694.82   |

注:1. 本期资产负债表为本基金报告期资产负债表。2. 资产负债表日为2013年6月30日,基金资产净值9,994元,基金负债总额为307,148,737.46元。

单位:人民币元

| 项目                    | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上期 2012年12月31日至2013年6月30日 |
|-----------------------|-------------------------|---------------------------|
| 一、收入                  | 1,663,728.53            | -                         |
| 1.利息收入                | 5,736,293.09            | -                         |
| 其中:存款利息收入             | 118,351.33              | -                         |
| 债券利息收入                | 3,788,706.39            | -                         |
| 资产支持证券利息收入            | -                       | -                         |
| 买入返售金融资产收入            | 1,829,235.60            | -                         |
| 其他利息收入                | -                       | -                         |
| 2.投资收益(损失以“-”填列)      | -3,105,166.44           | -                         |
| 其中:股票投资收益             | -1,743,625.86           | -                         |
| 基金投资收益                | -                       | -                         |
| 债券投资收益                | -1,438,504.69           | -                         |
| 资产支持证券投资收益            | -                       | -                         |
| 衍生工具收益                | -                       | -                         |
| 股利收益                  | 76,964.11               | -                         |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | -1,165,088.50           | -                         |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列)     | -                       | -                         |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列)     | 197,690.38              | -                         |
| 减:一、费用                | 3,854,897.87            | -                         |
| 1.管理费                 | 1,971,038.39            | -                         |
| 2.托管费                 | 328,506.35              | -                         |
| 3.销售服务费               | -                       | -                         |
| 4.交易费用                | 764,883.53              | -                         |
| 5.利息支出                | 591,406.17              | -                         |
| 其中:卖出回购金融资产支出         | 591,406.17              | -                         |
| 6.其他费用                | 199,063.43              | -                         |
| 二、利润总额(亏损总额以“-”号填列)   | -2,191,169.34           | -                         |
| 减:所得税费用               | -                       | -                         |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列)     | -2,191,169.34           | -                         |

注:本基金成立于2012年12月20日,无上年度可比期间,因此财务报表列示自2013年1月1日至2013年6月30日数据,特此说明。

单位:人民币元

| 项目                                | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上期 2012年12月31日至2013年6月30日 |
|-----------------------------------|-------------------------|---------------------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)                   | 346,541,926.63          | 294,903.70                |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)          | -2,191,169.34           | -2,191,169.34             |
| 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) | -39,393,189.17          | -26,885.83                |
| 其中:1.基金申购款                        | 117,237.41              | 561.81                    |
| 2.基金赎回款(以“-”号填列)                  | -39,510,426.58          | -27,447.64                |
| 四、期末所有者权益(基金净值)                   | 307,148,737.46          | -1,923,151.47             |

注:本基金成立于2012年12月20日,无上年度可比期间,因此财务报表列示自2013年1月1日至2013年6月30日数据,特此说明。

单位:人民币元

| 项目                                | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上期 2012年12月31日至2013年6月30日 |
|-----------------------------------|-------------------------|---------------------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)                   | 346,541,926.63          | 294,903.70                |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)          | -2,191,169.34           | -2,191,169.34             |
| 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) | -39,393,189.17          | -26,885.83                |
| 其中:1.基金申购款                        | 117,237.41              | 561.81                    |
| 2.基金赎回款(以“-”号填列)                  | -39,510,426.58          | -27,447.64                |
| 四、期末所有者权益(基金净值)                   | 307,148,737.46          | -1,923,151.47             |

注:本基金成立于2012年12月20日,无上年度可比期间,因此财务报表列示自2013年1月1日至2013年6月30日数据,特此说明。

单位:人民币元

| 项目                                | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上期 2012年12月31日至2013年6月30日 |
|-----------------------------------|-------------------------|---------------------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)                   | 346,541,926.63          | 294,903.70                |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)          | -2,191,169.34           | -2,191,169.34             |
| 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) | -39,393,189.17          | -26,885.83                |
| 其中:1.基金申购款                        | 117,237.41              | 561.81                    |
| 2.基金赎回款(以“-”号填列)                  | -39,510,426.58          | -27,447.64                |
| 四、期末所有者权益(基金净值)                   | 307,148,737.46          | -1,923,151.47             |

注:本基金成立于2012年12月20日,无上年度可比期间,因此财务报表列示自2013年1月1日至2013年6月30日数据,特此说明。

单位:人民币元

| 项目                                | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上期 2012年12月31日至2013年6月30日 |
|-----------------------------------|-------------------------|---------------------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)                   | 346,541,926.63          | 294,903.70                |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)          | -2,191,169.34           | -2,191,169.34             |
| 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) | -39,393,189.17          | -26,885.83                |
| 其中:1.基金申购款                        | 117,237.41              | 561.81                    |
| 2.基金赎回款(以“-”号填列)                  | -39,510,426.58          | -27,447.64                |
| 四、期末所有者权益(基金净值)                   | 307,148,737.46          | -1,923,151.47             |

注:本基金成立于2012年12月20日,无上年度可比期间,因此财务报表列示自