

**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**

**2019 年半年度报告摘要**

**2019 年 06 月 30 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**

**送出日期:2019 年 08 月 27 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2019年8月23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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

基金管理人于2017年4月14日起对本基金增设收取销售服务费的C类份额，基金简称：中证财通可持续发展100指数C，基金代码：003184，基金份额持有人持有的原份额变更为A类份额，基金简称：中证财通可持续发展100指数A，基金代码：000042。

本报告期自2019年1月1日起至6月30日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	
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	
报告期末基金份额总额	332,710,551.17份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中证财通可持续发展 100指数A	中证财通可持续发展 100指数C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	000042	003184
报告期末下属分级基金的份额总额	332,710,551.17份	0.00份

注：(1)本基金自2017年4月14日起增设收取销售服务费的C类份额，原份额变更为A类份额；

(2)截至报告期末，本基金C类份额份额数为0。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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。</p> <p>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%。</p>
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。	
下属分级基金的风险收益特征	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。	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。

注: 本基金自2017年4月14日起增设收取销售服务费的C类份额,原份额变更为A类份额。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	财通基金管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	武祎
	联系电话	021-20537888
	电子邮箱	service@ctfund.com
客户服务电话	400-820-9888	95594
传真	021-20537999	021-68476936

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ctfund.com">http://www.ctfund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日-2019年06月30日)	
	中证财通可持续发展100指数A	中证财通可持续发展100指数C
本期已实现收益	15,507,968.91	-
本期利润	33,505,995.11	-
加权平均基金份额本期利润	0.2405	-
本期基金份额净值增长率	21.86%	-
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.5055	-
期末基金资产净值	500,879,506.14	-
期末基金份额净值	1.5055	1.0000

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)期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

(4)截至报告期末，本基金C类份额份数为0，C类份额初始净值为1.0000元；

(5)本基金自2017年4月14日起将各类基金份额净值计算保留到小数点后的位数更改为4位。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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

中证财通可持续发展100指数A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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

过去一个月	4.58%	1.02%	3.02%	1.03%	1.56%	-0.01%
过去三个月	-1.85%	1.32%	-3.33%	1.45%	1.48%	-0.13%
过去六个月	21.86%	1.37%	20.39%	1.46%	1.47%	-0.09%
过去一年	11.44%	1.37%	6.23%	1.42%	5.21%	-0.05%
过去三年	33.64%	1.02%	26.20%	1.05%	7.44%	-0.03%
自基金合同生效起至今 (2013年3月22日-2019年06月30日)	75.88%	1.34%	54.21%	1.45%	21.67%	-0.11%

### 中证财通可持续发展100指数C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	0.00%	0.00%	3.02%	1.03%	-3.02%	-1.03%
过去三个月	0.00%	0.00%	-3.33%	1.45%	3.33%	-1.45%
过去六个月	0.00%	0.00%	20.39%	1.46%	-20.39%	-1.46%
过去一年	0.00%	0.00%	6.23%	1.42%	-6.23%	-1.42%
自基金合同生效起至今 (2017年04月14日-2019年06月30日)	0.00%	0.00%	3.59%	1.14%	-3.59%	-1.14%

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)本基金自2017年4月14日起增设收取销售服务费的C类份额，原份额变更为A类份额；

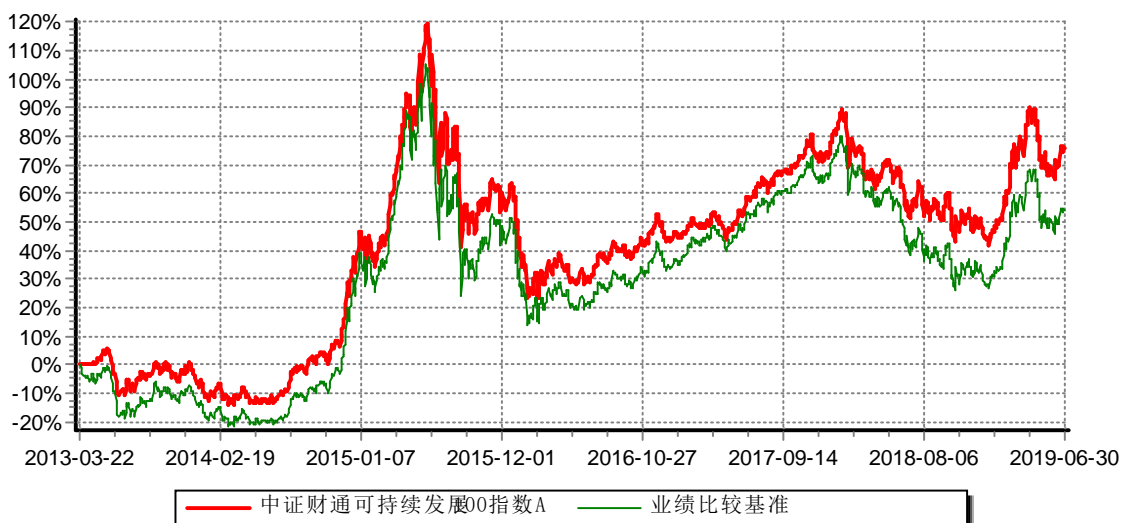
(4)中证财通可持续发展100指数C报告期内未有C类份额申购数据，报告期内单位净值为1.0000元。

### 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

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A

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-2019年6月30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： $\geq 80\%$ ；投资于权证的资产占基金资产净值： $\leq 3\%$ ；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值： $\geq 5\%$ 。本基金的建仓期为2013年3月22日至2013年9月22日；截至报告期末，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的比例低于80%，系被动超标，已在规定期限内调整至合规。除上述情况外，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；

(3) 本基金自2017年4月14日起增设收取销售服务费的C类份额，原份额变更为A类份额。

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C

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年04月14日-2019年6月30日)



注：(1)本基金合同生效日为2013年3月22日；自2017年4月14日起本基金增设收取销售服务费的C类份额；报告期内未有C类份额申购数据，报告期内单位净值为1.0000元。

(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： $\geq 80\%$ ；投资于权证的资产占基金资产净值： $\leq 3\%$ ；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值： $\geq 5\%$ 。本基金的建仓期为2013年3月22日至2013年9月22日；截至报告期末，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的比例低于80%，系被动超标，已在规定期限内调整至合规。除上述情况外，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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

财通基金管理有限公司成立于2011年6月，由财通证券股份有限公司、杭州市实业投资集团有限公司和浙江瀚叶股份有限公司共同发起设立，财通证券股份有限公司为第一大股东，出资比例40%。公司注册资本2亿元人民币，注册地上海，经营范围为基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。

财通基金始终秉承“持有人利益至上”的核心价值观，致力于为客户提供专业优质的资产管理服务。在公募业务方面，公司坚持以客户利益为出发点设计产品，逐步建立起覆盖各种投资标的、各种风险收益特征的产品线，获得一定市场口碑；公司将特定客户资产管理业务作为重要发展战略之一，形成玉泉系列、富春系列等多个子品牌，产品具有追求绝对收益、标的丰富、方案灵活等特点，为机构客户、高端个人客户提供个性化的理财选择。

公司现有员工165人，管理人员和主要业务骨干的证券、基金从业平均年限在10年以上。通过提供多维度、人性化的客户服务，财通基金始终与持有人保持信息透明；通



过建立完备的风险控制体系，财通基金最大限度地保证客户的利益。公司将以专业的投资能力、规范的公司治理、诚信至上的服务、力求创新的精神为广大投资者创造价值。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴迪	本基金的基金经理	2016年4月21日	-	8年	复旦大学世界经济硕士。曾任职于信诚基金产品开发部。2012年5月加入财通基金管理有限公司，先后担任战略产品部产品经理、量化投资部研究员，自2015年8月起开始担任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经理助理，现任量化投资二部基金经理。
苏俊杰	本基金的基金经理、量化投资二部总监助理	2018年01月31日	-	6年	清华大学学士，美国芝加哥大学金融数学硕士，CFA。历任MSCI Inc.分析员，华泰柏瑞基金量化投资部研究员、专户投资经理。2017年7月加入财通基金管理有限公司，现任量化投资二部总监助理。

注：（1）基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

（2）非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

（3）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) 本基金自2019年7月16日起增聘朱海东为基金经理，原基金经理苏俊杰因个人原因于2019年7月26日离职。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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，本基金参与上市公司定向增发项目，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。

本投资组合为指数增强型开放式基金。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易（短期国债回购交易除外）的情况，也未发生影响市场价格的临近日同向或反向交易。

经过事前制度约束、事中严密监控，以及事后的统计排查，本报告期内各笔交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明，本期基金运作未对市场产生有违公允性的影响，亦未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年上半年，中国经济在全球流动性宽松和国内稳增长政策作用下出现了一波向上脉冲，但之后受到制造业投资不振、基建乏力和中美贸易摩擦等因素影响重新面临下行压力。PPI回升趋势在二季度出现逆转，但CPI下行趋势仍不明显。国内政策尚处于观察期，贸易摩擦对经济的迟滞影响将逐步显现，需要更多基本面恶化的证据，政策才有可能重回全面的稳增长导向。伴随经济基本面的变化，A股市场波动率在上半年有所放大，在4月下旬之前呈现出比较典型的“春季躁动”走势，随后进入整理区间。行业层面，消费和农林牧渔贡献了比较持续的超额收益；因子层面，预期类因子表现较好，盈利和估值因子表现较之前有所弱化。

报告期内，本基金实施了量化增强策略，并积极参与新股申购，相对业绩基准创造了比较显著的超额收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中证财通可持续发展100指数A基金份额净值为1.5055元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为21.86%，同期业绩比较基准收益率为20.39%；截至报告期末中证财通可持续发展100指数C基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.00%，同期业绩比较基准收益率为20.39%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年下半年，国内经济的下行压力依然较大，贸易摩擦在短时期内难以解决，房地产投资向下拐头的趋势比较明显，三四线城市面临棚改政策退坡后的需求真空，统计局口径的房地产销售面临较大压力。但应该看到，中国正在朝结构转型和产业升级的方向迈进，在总量增速承压的情况下，经济仍有可能呈现局部亮点。此外，决策层可施展的政策工具还很丰富，经济大幅失速的概率不高。从结构上看，对流动性敏感的成长性行业以及直接受益于产业政策刺激的板块有望实现超额收益，经济强周期性行业可能表现处于弱勢。

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。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会《关于证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》等法律法规的有关规定，本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。

估值委员会成员由总经理、督察长、基金投资部、专户投资部、固定收益部、研究部、风险管理部、监察稽核部、基金清算部等部门负责人、基金清算部相关业务人员、涉及的相关基金经理或投资经理或实际履行前述部门相当职责的部门负责人或人员组成。估值委员会成员均具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司于2013年9月签订了《基金估值核算业务外包协议》。

根据中国证券投资基金业协会《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发〔2017〕6号），基金管理人与中证指数有限公司签订了《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》，委托中证指数有限公司计算并提供流通受限股票流动性折扣。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司上海市分行于2018年6月签订了《基金行政外包协议》，与中信中证投资服务有限责任公司于2019年7月签订了《行政管理服务协议》，截至报告期末，基金管理人对旗下部分特定客户资产管理计划估值业务实行外包。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

根据相关法律法规及《基金合同》的要求，结合本基金运作情况，本报告期内本基金共分红1次，每份合计分红0.2536元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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人或者基金资产净值低于5000万元的情况出现。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。报告期内，本基金对基金持有人进行了一次利润分配，分配金额为84,234,416.38元

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### §6 半年度财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款		28,554,136.05	5,095,438.93
结算备付金		4,948,191.09	137,110.62
存出保证金		383,887.07	31,007.51
交易性金融资产		468,474,326.41	79,835,768.81

其中：股票投资		468,474,326.41	79,835,768.81
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		9,726.17	1,190.28
应收股利		-	-
应收申购款		23,679.63	8,267.36
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		502,393,946.42	85,108,783.51
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年06月30日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		100,241.88	-
应付赎回款		80,809.23	557.66
应付管理人报酬		452,397.69	73,361.37
应付托管费		67,859.66	11,004.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		554,758.18	66,188.60
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债		258,373.64	380,001.37
负债合计		1,514,440.28	531,113.20
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		332,710,551.17	58,600,082.12
未分配利润		168,168,954.97	25,977,588.19
所有者权益合计		500,879,506.14	84,577,670.31
负债和所有者权益总计		502,393,946.42	85,108,783.51

注：(1)后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(2)报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.5055元，基金份额总额332,710,551.17份。

## 6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间2018年01月01日至2018年06月30日
<b>一、收入</b>		36,012,755.80	-8,007,797.59
1.利息收入		112,605.70	22,577.75
其中：存款利息收入		112,605.70	22,577.75
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		17,883,161.70	6,384,967.03
其中：股票投资收益		11,151,300.19	5,536,342.86
基金投资收益		-	-

债券投资收益		-	-
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		6,731,861.51	848,624.17
3.公允价值变动收益(损失 以“-”号填列)		17,998,026.20	-14,420,312.57
4.汇兑收益(损失以“-” 号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号 填列)		18,962.20	4,970.20
<b>减：二、费用</b>		<b>2,506,760.69</b>	<b>1,088,106.78</b>
1. 管理人报酬		1,128,721.48	485,717.89
2. 托管费		169,308.22	72,857.68
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		1,049,767.53	339,616.65
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用		158,963.46	189,914.56
<b>三、利润总额(亏损总额 以“-”号填列)</b>		<b>33,505,995.11</b>	<b>-9,095,904.37</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-” 号填列)</b>		<b>33,505,995.11</b>	<b>-9,095,904.37</b>

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：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

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日



单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30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)	58,600,082.12	25,977,588.19	84,577,670.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	33,505,995.11	33,505,995.11
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)	274,110,469.05	192,919,788.05	467,030,257.10
其中：1.基金申购款	280,268,955.83	197,619,211.38	477,888,167.21
2.基金赎回款	-6,158,486.78	-4,699,423.33	-10,857,910.11
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)	-	-84,234,416.38	-84,234,416.38
五、期末所有者权益 (基金净值)	332,710,551.17	168,168,954.97	500,879,506.14
项目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30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)	57,524,761.74	42,445,569.38	99,970,331.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,095,904.37	-9,095,904.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值	97,074.27	-35,147.75	61,926.52

变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	3,618,426.83	2,715,646.94	6,334,073.77
2.基金赎回款	-3,521,352.56	-2,750,794.69	-6,272,147.25
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)	57,621,836.01	33,314,517.26	90,936,353.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

王家俊

王家俊

刘为臻

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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 (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[2013]100号《关于核准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募集的批复》的核准, 由基金管理人财通基金管理有限公司向社会公开发行募集, 基金合同于2013年3月22日正式生效, 首次设立募集规模为247,395,794.87份基金份额。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为财通基金管理有限公司, 基金托管人为上海银行股份有限公司。

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、银行存款、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及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相关规定)。其中, 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不低于基金资产的80%; 投资于权证的资产不超过基金资产净值的3%; 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的

5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构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%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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（以下统称“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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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3号《半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。

#### 6.4.3 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2019年6月30日的财务状况以及2019年上半年的经营成果和净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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

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。

#### 6.4.5 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。

#### 6.4.6 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[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. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

## 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

## 4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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。

#### 5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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[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；

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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于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2015年9月8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，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 关联方关系

#### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

#### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
上海银行股份有限公司("上海银行")	基金托管人、基金代销机构

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。

### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至201 9年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至201 8年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,128,721.48	485,717.89
其中：支付销售机构的客户维护费	56,030.70	43,978.89

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1.00%的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付；

(2)基金管理人管理费计算公式为：日基金管理人管理费=前一日基金资产净值×1.00%/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。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019 年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	169,308.22	72,857.68

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0.15%的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付；

(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×0.15% / 当年天数。

### 6.4.8.2.3 销售服务费

基金管理人于2017年4月14日起对本基金增设收取销售服务费的C类份额，报告期内，C类份额未有申购数据。

### 6.4.8.3 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未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期 2019年01月01日-2019年06 月30日		上年度可比期间 2018年01月01日-2018年 06月30日	
	中证财通可持 续发展100指 数A	中证财通 可持 续发 展100指 数 C	中证财通可 持续发展100 指数A	中证财通 可持 续发 展100指 数 C
期初持有的基金份额	1,828,670.63	—	1,828,670.63	—
期间申购/买入总份额	—	—	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	1,828,670.63	—	1,828,670.63	—
占基金总份额比例	0.55%	—	3.17%	—

注：(1)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；

(2)基金管理人运用自有资金3,000,000.00元申购本基金，适用费率为0.40%；

(3)本基金自2017年4月14日起增设收取销售服务费的C类份额，原份额变更为A类份额。

#### 6.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.8.5 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 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行活期存款	28,554,136.05	72,184.44	5,634,785.25	20,491.56

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 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。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.8.7.1 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无其他关联交易事项的说明。

##### 6.4.8.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间无当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

#### 6.4.9 期末（2019年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新发流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券



#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 6.4.9.3.2 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。

### 6.4.10 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2019年6月30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468,440,456.47元，属于第二层次的余额为人民币33,869.94元，无属于第三层次的余额。

于2018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79,792,565.55元，属于第二层次的余额为人民币43,203.26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可转换债券，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可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

###### (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未发生变动。

#### 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。

## §7 投资组合报告

### 7.1 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	468,474,326.41	93.25
	其中：股票	468,474,326.41	93.25
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	33,502,327.14	6.67
8	其他各项资产	417,292.87	0.08
9	合计	502,393,946.42	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

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	11,406,402.47	2.28
C	制造业	178,126,733.77	35.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,011,522.62	2.00
E	建筑业	34,101,563.08	6.81
F	批发和零售业	6,978,706.64	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	22,753,448.67	4.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,545,984.19	4.70

J	金融业	82,959,962.36	16.56
K	房地产业	29,213,345.84	5.83
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	1,493,373.40	0.30
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	400,591,043.04	79.98

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

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	326,628.00	0.07
B	采矿业	6,146,093.72	1.23
C	制造业	35,270,637.25	7.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,839,150.00	0.37
E	建筑业	5,245,997.12	1.05
F	批发和零售业	13,555,362.13	2.71
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	2,222,495.21	0.44
J	金融业	1,596,947.94	0.32
K	房地产业	1,307,945.00	0.26
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	372,027.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	67,883,283.37	13.55

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。

## 7.3 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

### 7.3.1 期末指数投资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	000568	泸州老窖	196,717	15,900,635.11	3.17
2	000858	五粮液	115,971	13,678,779.45	2.73
3	000783	长江证券	1,741,230	13,599,006.30	2.72
4	000157	中联重科	2,091,700	12,571,117.00	2.51
5	601009	南京银行	1,508,887	12,463,406.62	2.49
6	600383	金地集团	1,040,500	12,413,165.00	2.48
7	600000	浦发银行	1,062,100	12,405,328.00	2.48
8	002146	荣盛发展	1,289,356	12,107,052.84	2.42
9	000425	徐工机械	2,676,600	11,937,636.00	2.38
10	601668	中国建筑	2,017,282	11,599,371.50	2.32

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半年度报告正文。

### 7.3.2 期末积极投资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	603160	汇顶科技	51,799	7,189,701.20	1.44
2	601607	上海医药	327,720	5,948,118.00	1.19
3	600985	淮北矿业	516,098	5,852,551.32	1.17
4	600170	上海建工	1,395,212	5,245,997.12	1.05
5	002020	京新药业	434,700	5,007,744.00	1.00
6	600312	平高电气	615,800	4,735,502.00	0.95
7	002601	龙蟒佰利	261,791	3,882,360.53	0.78
8	603313	梦百合	172,658	2,985,256.82	0.60
9	000547	航天发展	304,800	2,913,888.00	0.58
10	600827	百联股份	257,117	2,522,317.77	0.50

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半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 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

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	000568	泸州老窖	18,508,342.22	21.88
2	000783	长江证券	16,294,964.70	19.27
3	601009	南京银行	14,790,917.65	17.49
4	600000	浦发银行	14,116,272.79	16.69
5	000425	徐工机械	13,750,449.00	16.26
6	601166	兴业银行	13,737,069.92	16.24
7	601668	中国建筑	13,655,428.70	16.15
8	600011	华能国际	13,531,126.36	16.00
9	000858	五粮液	13,105,528.80	15.50
10	000157	中联重科	12,885,932.00	15.24
11	600690	海尔智家	12,514,605.36	14.80
12	002146	荣盛发展	11,894,935.38	14.06

13	600383	金地集团	11,839,225.68	14.00
14	601117	中国化学	11,477,762.93	13.57
15	600104	上汽集团	11,398,416.68	13.48
16	600050	中国联通	11,123,754.43	13.15
17	601006	大秦铁路	11,094,677.50	13.12
18	600188	兖州煤业	11,086,614.55	13.11
19	600332	白云山	10,483,072.62	12.39
20	002236	大华股份	9,684,023.00	11.45
21	000625	长安汽车	9,320,913.63	11.02
22	601818	光大银行	8,970,613.00	10.61
23	002202	金风科技	8,821,452.88	10.43
24	601111	中国国航	8,686,375.58	10.27
25	000895	双汇发展	8,662,271.02	10.24
26	000876	新希望	8,566,370.97	10.13
27	000001	平安银行	8,143,668.00	9.63
28	600153	建发股份	8,085,595.52	9.56
29	600196	复星医药	8,052,356.40	9.52
30	601186	中国铁建	8,022,481.00	9.49
31	600985	淮北矿业	7,983,485.96	9.44
32	603160	汇顶科技	7,696,359.25	9.10
33	600219	南山铝业	7,680,345.00	9.08
34	002153	石基信息	7,637,751.86	9.03
35	600271	航天信息	7,448,629.97	8.81
36	601919	中远海控	7,295,199.72	8.63
37	601607	上海医药	7,270,714.60	8.60
38	600019	宝钢股份	7,233,970.90	8.55
39	601998	中信银行	7,041,227.00	8.33
40	600048	保利地产	6,860,071.00	8.11
41	000100	TCL 集团	6,599,147.00	7.80
42	600170	上海建工	6,496,126.32	7.68
43	600111	北方稀土	6,310,582.00	7.46

44	002020	京新药业	5,915,264.00	6.99
45	600309	万华化学	5,814,694.16	6.87
46	600312	平高电气	5,520,470.00	6.53
47	600406	国电南瑞	5,456,161.24	6.45
48	002415	海康威视	5,371,587.00	6.35
49	002007	华兰生物	4,915,894.22	5.81
50	600893	航发动力	4,856,955.70	5.74
51	000651	格力电器	4,820,388.13	5.70
52	002601	龙蟒佰利	4,738,016.33	5.60
53	002230	科大讯飞	4,636,028.50	5.48
54	600066	宇通客车	4,543,641.00	5.37
55	601601	中国太保	4,540,097.52	5.37
56	002092	中泰化学	4,520,766.84	5.35
57	600519	贵州茅台	3,950,701.99	4.67
58	603313	梦百合	3,841,856.55	4.54
59	000547	航天发展	3,680,876.00	4.35
60	600588	用友网络	3,666,127.50	4.33
61	601398	工商银行	3,529,476.00	4.17
62	002304	洋河股份	3,456,231.00	4.09
63	601390	中国中铁	3,420,812.00	4.04
64	000776	广发证券	3,370,680.00	3.99
65	000034	神州数码	3,370,122.00	3.98
66	600688	上海石化	3,363,618.07	3.98
67	600827	百联股份	3,325,628.34	3.93
68	600741	华域汽车	3,175,300.00	3.75
69	600919	江苏银行	3,074,699.00	3.64
70	000338	潍柴动力	3,059,927.07	3.62
71	601600	中国铝业	3,025,062.00	3.58
72	601991	大唐发电	2,969,610.44	3.51
73	601898	中煤能源	2,925,575.00	3.46
74	000401	冀东水泥	2,828,476.00	3.34

75	000028	国药一致	2,782,805.22	3.29
76	002555	三七互娱	2,718,218.53	3.21
77	000600	建投能源	2,679,655.00	3.17
78	601618	中国中冶	2,530,583.88	2.99
79	600606	绿地控股	2,379,164.00	2.81
80	600016	民生银行	2,291,685.20	2.71
81	000951	中国重汽	2,254,633.00	2.67
82	601288	农业银行	2,224,919.00	2.63
83	600031	三一重工	2,217,232.42	2.62
84	600036	招商银行	2,200,970.00	2.60
85	600015	华夏银行	2,197,002.00	2.60
86	002299	圣农发展	2,097,544.94	2.48
87	000630	铜陵有色	2,067,575.40	2.44
88	601018	宁波港	2,013,610.40	2.38
89	000676	智度股份	1,751,265.00	2.07
90	603508	思维列控	1,719,653.00	2.03

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。

#### 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

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	000651	格力电器	7,476,098.60	8.84
2	000568	泸州老窖	7,241,967.00	8.56
3	600588	用友网络	5,487,752.36	6.49
4	601166	兴业银行	5,317,717.00	6.29
5	000157	中联重科	5,226,548.00	6.18
6	601117	中国化学	4,736,778.00	5.60
7	601919	中远海控	4,631,402.40	5.48
8	600332	白云山	4,345,555.35	5.14
9	600741	华域汽车	4,329,324.76	5.12
10	000625	长安汽车	4,060,360.09	4.80



11	000858	五 粮 液	3,893,264.00	4.60
12	002304	洋河股份	3,733,220.55	4.41
13	002007	华兰生物	3,730,056.51	4.41
14	600406	国电南瑞	3,650,523.95	4.32
15	601601	中国太保	3,482,596.00	4.12
16	002153	石基信息	3,438,812.03	4.07
17	002092	中泰化学	3,172,570.32	3.75
18	600011	华能国际	3,097,464.00	3.66
19	000776	广发证券	3,001,747.00	3.55
20	600111	北方稀土	2,943,732.00	3.48
21	000783	长江证券	2,885,802.00	3.41
22	000425	徐工机械	2,870,403.00	3.39
23	600383	金地集团	2,867,377.00	3.39
24	600050	中国联通	2,821,717.00	3.34
25	000001	平安银行	2,775,780.00	3.28
26	600271	航天信息	2,774,364.00	3.28
27	601898	中煤能源	2,763,735.71	3.27
28	601991	大唐发电	2,720,808.98	3.22
29	000876	新 希 望	2,717,378.00	3.21
30	600893	航发动力	2,708,852.00	3.20
31	600104	上汽集团	2,698,407.00	3.19
32	600690	海尔智家	2,602,068.00	3.08
33	000895	双汇发展	2,531,561.00	2.99
34	600036	招商银行	2,506,006.42	2.96
35	002146	荣盛发展	2,475,543.80	2.93
36	600219	南山铝业	2,463,790.76	2.91
37	002299	圣农发展	2,401,539.05	2.84
38	600016	民生银行	2,380,763.00	2.81
39	600153	建发股份	2,375,273.00	2.81
40	601288	农业银行	2,370,153.00	2.80
41	002236	大华股份	2,365,193.94	2.80

42	000338	潍柴动力	2,333,080.00	2.76
43	601818	光大银行	2,331,028.00	2.76
44	600688	上海石化	2,298,421.45	2.72
45	601009	南京银行	2,295,853.00	2.71
46	600985	淮北矿业	2,289,978.15	2.71
47	600000	浦发银行	2,168,346.28	2.56
48	600031	三一重工	2,119,595.56	2.51
49	600048	保利地产	2,087,972.00	2.47
50	601006	大秦铁路	2,083,742.00	2.46
51	600188	兖州煤业	2,083,583.00	2.46
52	601668	中国建筑	2,069,762.00	2.45
53	600015	华夏银行	2,015,873.00	2.38
54	000951	中国重汽	1,994,066.00	2.36
55	601186	中国铁建	1,983,920.00	2.35
56	601018	宁波港	1,962,420.00	2.32
57	601618	中国中冶	1,938,785.68	2.29
58	002230	科大讯飞	1,921,647.00	2.27
59	600066	宇通客车	1,908,076.00	2.26
60	603993	洛阳钼业	1,905,956.00	2.25
61	000709	河钢股份	1,905,155.00	2.25
62	002081	金螳螂	1,882,446.00	2.23
63	600309	万华化学	1,817,760.00	2.15
64	002475	立讯精密	1,800,466.00	2.13
65	601111	中国国航	1,793,829.00	2.12
66	603508	思维列控	1,765,640.90	2.09
67	002202	金风科技	1,763,392.00	2.08
68	000676	智度股份	1,704,057.00	2.01

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	648,801,526.55
卖出股票收入（成交）总额	289,312,295.34

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 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持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 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。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1 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。**

根据公开信息，本基金投资的前十名证券五粮液（证券代码：000858）于2018年8月24日晚间，从四川省纪委、监察委网站获悉本公司监事、监事会主席余铭书涉嫌严重违纪违法，目前正接受纪律审查和监察调查。

**7.12.2 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。**

### 7.12.3 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	383,887.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,726.17
5	应收申购款	23,679.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	417,292.87

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资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。

### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 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。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中证财通可持续发展100指数A	1,664	199,946.24	314,015,403.52	94.38%	18,695,147.65	5.62%
中证财通可持续发展100指数C	0.00	0.00	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	1,664	199,946.24	314,015,403.52	94.38%	18,695,147.65	5.62%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用期末基金份额总额，特此说明。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中证财通可持续发展100指数A	6,441.74	0.00%
	中证财通可持续发展100指数C	0.00	0.00%

	0指数C		
	合计	6,441.74	0.00%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	中证财通可持续发展100指数A	0
	中证财通可持续发展100指数C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中证财通可持续发展100指数A	0
	中证财通可持续发展100指数C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	中证财通可持续发展100指数A	中证财通可持续发展100指数C
基金合同生效日(2013年03月22日)基金份额总额	247,395,794.87	-
本报告期期初基金份额总额	58,600,082.12	-
本报告期基金总申购份额	280,268,955.83	-
减：本报告期基金总赎回份额	6,158,486.78	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	332,710,551.17	-

注：(1)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；

(2) 本基金自2017年4月14日起增设收取销售服务费的C类份额，原份额变更为A类份额；

(3)报告期内，C类份额未有申购数据。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期内，基金管理人于2019年1月18日聘任夏理芬先生担任公司董事长职务；
- 2、本报告期内，于2019年4月王蕤女士不再担任上海银行股份有限公司资产托管部副总经理职务。上述人事变动已进行备案、公告。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	936,523,722.33	100.00%	677,374.74	100.00%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全的证券经营机构；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

(1)投资、研究部门与券商联系商讨合作意向，根据公司对券商交易单元的选择标准，确定选用交易单元的所属券商以及（主）交易单元，报投资总监与总经理审核批准；

(2)集中交易部与券商商议交易单元租用协议，经相关业务部门确认后，报公司领导审批；

(3)基金清算部负责对接托管行、各证券交易所、中登公司上海和深圳分公司办理交易单元手续及账户开户手续。

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019-05-10 至 2019-6-30	0.00	67,934,191.87	0.00	67,934,191.87	20.42%
机构	2	2019-05-06 至 2019-5-09	0.00	39,537,390.72	0.00	39,537,390.72	11.88%
机构	3	2017-03-15 至 2019-5-09	33,533,869.89	0.00	0.00	33,533,869.89	10.08%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>目标指数回报与股票市场平均回报偏离的风险；目标指数波动的风险；基金投资组合回报与目标指数回报偏离的风险；目标指数变更的风险。</p> <p>在报告期内，本基金单一投资者持有的基金份额已超过20%，可能对基金运作造成如下风险：</p> <p>(1)赎回申请延缓支付的风险</p> <p>该等投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与该等投资者按同比例延缓支付赎回款项的风险。</p> <p>(2)基金净值大幅波动的风险</p> <p>该等投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；</p> <p>(3)基金规模过小导致的风险</p> <p>该等投资者赎回后，很可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，实现基金投资目标存在一定的不确定性。</p>							



## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

财通基金管理有限公司  
二〇一九年八月二十七日