

**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
2018年半年度报告摘要**

2018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：2018年08月29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2018年8月28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2018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	57,621,836.01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	57,621,836.01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	<p>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</p>

	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	闻怡
	联系电话	021-20537888	021-68475888
	电子邮箱	service@ctfund.com	custody@bosc.cn
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	http://www.ctfund.com
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(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
本期已实现收益	5,324,408.20	-
本期利润	-9,095,904.37	-
加权平均基金份额本期利润	-0.1596	-
本期基金份额净值增长率	-9.19%	-
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.5782	-
期末基金资产净值	90,936,353.27	-
期末基金份额净值	1.5782	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)中证财通可持续发展100指数C报告期自2018年1月1日起至6月30日，截至报告期末，本基金C类基金份额数为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	-5.50%	1.19%	-7.75%	1.12%	2.25%	0.07%
过去三个月	-5.87%	1.05%	-9.94%	1.02%	4.07%	0.03%
过去六个月	-9.19%	1.08%	-12.85%	1.06%	3.66%	0.02%
过去一年	-0.61%	0.89%	-5.13%	0.88%	4.52%	0.01%
过去三年	-19.56%	1.36%	-18.83%	1.48%	-0.73%	-0.12%
自基金合同生效起至今 (2013年3月22日-2018年06月30日)	57.82%	1.34%	45.16%	1.46%	12.66%	-0.12%

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%	-7.75%	1.12%	7.75%	-1.12%
过去三个月	0.00%	0.00%	-9.94%	1.02%	9.94%	-1.02%
过去六个月	0.00%	0.00%	-12.85%	1.06%	12.85%	-1.06%
过去一年	0.00%	0.00%	-5.13%	0.88%	5.13%	-0.88%
自基金合同生效起至今 (2017年04月14日-2018年06月30日)	0.00%	0.00%	-2.49%	0.85%	2.49%	-0.85%

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；

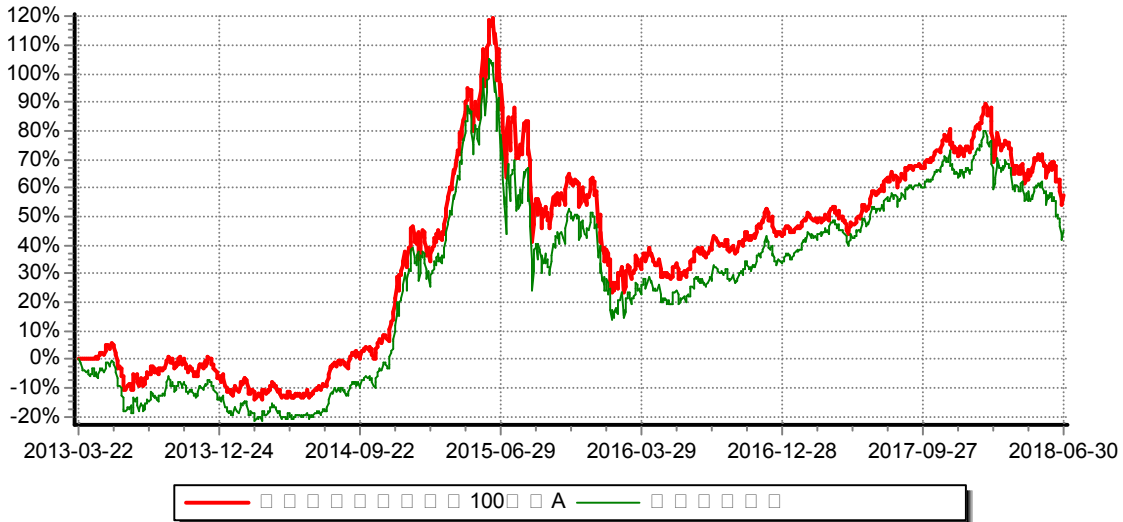
(4)中证财通可持续发展100指数C报告期内未有C类份额申购数据，报告期内单位净值为1.0000元。

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-2018年6月30日)



注：(1)本基金合同生效日为2013年3月22日；

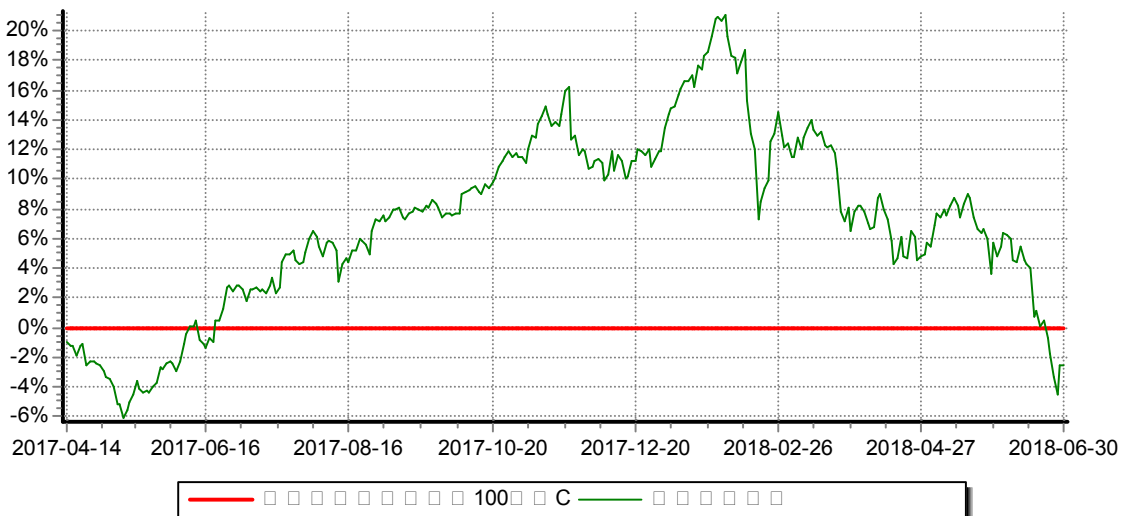
(2)本基金投资于中证财通中国可持续发展100（ECPI ESG）指数成份股和备选成份股的资产占基金资产： $\geq 80\%$ ；投资于权证的资产占基金资产净值： $\leq 3\%$ ；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值： $\geq 5\%$ 。本基金的建仓期为2013年3月22日至2013年9月22日；截至建仓期末及本报告期末，基金的资产配置符合基金契约的相关要求；

(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-2018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：≥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180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04月21日	-	7年	复旦大学世界经济硕士。2011年7月至2012年4月就职于信诚基金产品开发部。2012年5月加入财通基金，曾任战略产品部产品经理、量化投资部研究

					员。现为量化投资部基金经理。
苏俊杰	本基金的基金经理、量化投资二部总监助理	2018年1月31日	-	5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，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。

4.2 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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、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，本投资组合的主动型投资部分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

报告期内，本基金利用量化多因子模型进行了收益增强，同时积极参与新股申购，基金份额净值较业绩基准有较为明显的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018年上半年度，本基金A类份额净值增长率为-9.19%，业绩比较基准增长率为-12.85%，跑赢业绩比较基准3.66%；C类份额未有申购数据，报告期内单位净值为1.0000元。

自成立以来，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。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，国内总需求继续呈收缩之势，特别是基建投资下滑过快对全社会固定资产投资形成明显拖累。全国范围内房价上涨势头得到一定遏制，但地产调控在大方向上难

言放松。“去杠杆”政策对经济的影响逐渐体现，新增社会融资增速大幅回落，地方投资平台和民营企业融资环境趋紧，信用风险积聚。中美贸易战争端不断升级，虽然短期对经济的掣肘有限，但可能对中国经济长期发展路径产生深远影响，并严重打压风险偏好。人民币汇率呈现了快速贬值态势，反映了市场对于国内经济下行和贸易战影响的担忧，也降低了A股在全球资产配置组合中的吸引力。

针对形势的不断演进，从6月央行“超预期”宣布降准开始，在货币、财政以及监管方面政策调整的信号不断出现。预计下半年政府将加大财政支出力度，基建投资有望触底回升；“去杠杆”政策边际放松，社融增速有望企稳；人民币汇率可能继续面临一定贬值压力，但更多体现主动释放风险的政策意图，不具备大幅贬值基础。

在贸易战、金融去杠杆和经济下行预期的多重影响下，市场自二月初见顶后不断震荡下行。分板块看，强周期性行业和科技类行业均表现不佳；大市值公司整体表现较优，壳资源类公司在信用风险冲击下陷入局部“流动性危机”；有业绩支撑的板块表现相对抢眼。

市场在经历过去几个月的连续下跌后估值已经处于历史偏低的水平，对多重利空因素的影响预期已经比较充分，预计进一步大幅下跌的空间有限，更有可能进入一个缓慢“磨底”的过程。另一方面，虽然政策拐点大概率确立，但绝对不是“大水漫灌”式放松，加上人民币贬值压力会抑制海外资金流入，市场的向上空间将会受制于增量资金的匮乏。

从行业和风格上看，今年以来的行业轮动速度极快，每一波行业性机会的持续性较差，预计下半年在行业配置层面获取超额收益的难度依然较大；风格上，预计整体仍将维持偏大市值风格，在大市值风格占优的假设下，预计盈利能力、财务质量、业绩超预期等因子将会有比较好的表现。

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》，截至报告期末，基金管理人未对旗下公开募集证券投资基金及特定客户资产管理计划估值业务实行外包。

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。

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，本报告期内本基金未进行利润分配。

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。

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》、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，本基金未实施利润分配。

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：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款		5,634,785.25	5,869,319.76
结算备付金		189,629.79	16,085.17
存出保证金		32,910.79	15,098.47
交易性金融资产		85,555,072.86	94,245,513.30
其中：股票投资		85,555,072.86	94,245,513.30
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		-	608,694.03
应收利息		1,206.05	1,366.55
应收股利		-	-
应收申购款		31,767.58	2,692.40
递延所得税资产		-	-

其他资产		-	-
资产总计		91,445,372.32	100,758,769.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
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		-	313,329.95
应付赎回款		2,936.36	49.44
应付管理人报酬		77,695.24	84,497.29
应付托管费		11,654.27	12,674.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		77,460.22	37,887.10
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		339,272.96	340,000.19
负债合计		509,019.05	788,438.56
所有者权益：			
实收基金		57,621,836.01	57,524,761.74
未分配利润		33,314,517.26	42,445,569.38
所有者权益合计		90,936,353.27	99,970,331.12
负债和所有者权益总计		91,445,372.32	100,758,769.68

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2018年6月30日，基金份额净值1.5782元，基金份额总额57,621,836.01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：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入		-8,007,797.59	7,201,242.06
1.利息收入		22,577.75	22,609.36
其中：存款利息收入		22,577.75	22,609.36
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）		6,384,967.03	2,666,532.25
其中：股票投资收益		5,536,342.86	1,862,429.61
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		848,624.17	804,102.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-14,420,312.57	4,475,814.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		4,970.20	36,285.89
减：二、费用		1,088,106.78	668,435.33
1. 管理人报酬		485,717.89	297,050.50
2. 托管费		72,857.68	44,557.60

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		339,616.65	156,464.46
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		189,914.56	170,362.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,095,904.37	6,532,806.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,095,904.37	6,532,806.73

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：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 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变动数（净值减少以“-”号填列）	97,074.27	-35,147.75	61,926.52
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	-3,521,352.56	-2,750,794.69	-6,272,147.25

款			
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
项目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017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)	28,740,217.76	12,602,762.71	41,342,980.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,532,806.73	6,532,806.73
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）	21,026,855.60	10,123,404.59	31,150,260.19
其中：1.基金申购款	41,199,927.38	20,205,634.11	61,405,561.49
2.基金赎回款	-20,173,071.78	-10,082,229.52	-30,255,301.30
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）	49,767,073.36	29,258,974.03	79,026,047.39

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

许志雄

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号文《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于2013年2月19日至2013年3月19日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2013)验字第60951782_B24号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2013年3月22日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币247,363,937.66元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币31,857.21元，以上实收基金（本息）合计为人民币247,395,794.87元，折合247,395,794.87份基金份额。本基金的基金管理人为财通基金管理有限公司，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%。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%。

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2号《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2018年6月30日的财务状况以及2018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。本基金的具体缴纳标准如下：

城市维护建设税 - 按实际缴纳的流转税的7%计缴。

教育费附加 - 按实际缴纳的流转税的3%计缴。

地方教育附加 - 按实际缴纳的流转税的2%计缴。

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。

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 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。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 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。

6.4.8.2 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 2018年01月01日至201 8年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至201 7年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	485,717.89	297,050.50
其中：支付销售机构的客户维护费	43,978.89	40,511.51

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复

核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延;

(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	上年度可比期间
	2018年01月01日至2018年06月30日	2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	72,857.68	44,557.60

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,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延;

(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

注: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

份额单位:份

项目	本期		上年度可比期间	
	2018年01月01日-2018年06月30日		2017年01月01日-2017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	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		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	3.17%	—	3.67%	—

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)基金管理人运用固有资金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 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017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	5,634,785.25	20,491.56	4,737,229.09	19,131.72

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（2018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
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新发流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新发流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新发流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

注：流通受限股票的可流通日以上市公司发布的公告时间为准。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601390	中国中铁	2018-05-07	重大资产重组	7.47	2018-08-20	7.25	309,400	2,439,078.40	2,311,218.00	-
300118	东方日升	2018-05-07	重大资产重组	10.80	2018-08-07	9.63	53,100	635,211.40	573,480.00	-

注：流通受限股票的复牌日期以上市公司发布的公告时间为准。

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2018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82,582,344.71元，属于第二层次的余额为人民币2,972,728.15元，无属于第三层次的余额。

于2017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90,664,087.25元，属于第二层次的余额为人民币3,581,426.05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	85,555,072.86	93.56
	其中：股票	85,555,072.86	93.56
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	5,824,415.04	6.37
8	其他各项资产	65,884.42	0.07
9	合计	91,445,372.32	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 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	3,122,934.16	3.43
C	制造业	30,325,287.34	33.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,165,901.00	2.38
E	建筑业	7,187,259.20	7.90
F	批发和零售业	731,821.00	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	4,850,047.32	5.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,822,517.00	3.10
J	金融业	16,546,502.38	18.20
K	房地产业	5,306,303.67	5.84
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	73,058,573.07	80.34

7.2.1.2 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	167,688.00	0.18
B	采矿业	383,415.00	0.42
C	制造业	8,330,061.82	9.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	176,615.85	0.19
E	建筑业	799,637.98	0.88
F	批发和零售业	960,153.00	1.06
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	1,516,726.00	1.67
J	金融业	-	-
K	房地产业	80,976.00	0.09
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	81,226.14	0.09
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	12,496,499.79	13.74

7.2.2 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	600332	白云山	71,800	2,731,990.00	3.00
2	000338	潍柴动力	296,200	2,591,750.00	2.85
3	600104	上汽集团	72,100	2,522,779.00	2.77
4	000651	格力电器	52,900	2,494,235.00	2.74
5	601006	大秦铁路	282,892	2,322,543.32	2.55
6	601390	中国中铁	309,400	2,311,218.00	2.54
7	600741	华域汽车	96,600	2,291,352.00	2.52
8	601288	农业银行	658,500	2,265,240.00	2.49
9	601398	工商银行	422,700	2,248,764.00	2.47
10	002146	荣盛发展	250,479	2,186,681.67	2.40

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五名股票投资明细

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	002373	千方科技	108,200	1,412,010.00	1.55
2	600216	浙江医药	101,000	1,289,770.00	1.42
3	600516	方大炭素	51,100	1,245,818.00	1.37
4	002626	金达威	39,000	676,650.00	0.74
5	600569	安阳钢铁	165,500	652,070.00	0.72

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	002146	荣盛发展	3,397,928.00	3.40
2	600018	上港集团	2,548,840.00	2.55
3	601800	中国交建	2,328,117.20	2.33
4	000002	万科A	2,317,429.00	2.32
5	600188	兖州煤业	2,126,128.00	2.13
6	000100	TCL 集团	2,092,477.00	2.09
7	600011	华能国际	2,072,667.00	2.07
8	600104	上汽集团	2,068,496.00	2.07
9	600050	中国联通	2,061,020.00	2.06
10	002304	洋河股份	2,048,484.00	2.05
11	600332	白云山	2,037,573.00	2.04
12	600688	上海石化	1,998,473.00	2.00
13	600893	航发动力	1,938,627.00	1.94
14	000651	格力电器	1,870,576.00	1.87
15	601088	中国神华	1,818,146.00	1.82
16	601991	大唐发电	1,746,927.00	1.75
17	601601	中国太保	1,726,892.00	1.73
18	600219	南山铝业	1,719,682.00	1.72
19	000876	新希望	1,685,815.00	1.69
20	601668	中国建筑	1,661,698.00	1.66

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	600018	上港集团	3,448,176.92	3.45
2	600271	航天信息	2,397,578.00	2.40
3	601668	中国建筑	2,364,586.00	2.37
4	600519	贵州茅台	2,235,129.00	2.24
5	600019	宝钢股份	1,990,184.00	1.99
6	000709	河钢股份	1,962,973.00	1.96
7	002449	国星光电	1,817,571.10	1.82
8	600688	上海石化	1,761,173.00	1.76
9	600036	招商银行	1,689,936.00	1.69
10	600801	华新水泥	1,576,560.00	1.58
11	600755	厦门国贸	1,572,223.55	1.57
12	600893	航发动力	1,564,246.35	1.56
13	601088	中国神华	1,561,204.00	1.56
14	601800	中国交建	1,509,590.00	1.51
15	600188	兖州煤业	1,503,114.00	1.50
16	603167	渤海轮渡	1,475,744.00	1.48
17	002396	星网锐捷	1,462,256.00	1.46
18	603993	洛阳钼业	1,449,754.62	1.45
19	600153	建发股份	1,439,174.00	1.44
20	000002	万科A	1,392,048.03	1.39

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	129,771,084.21
卖出股票收入（成交）总额	129,577,554.94

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。

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	32,910.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	0.00
4	应收利息	1,206.05
5	应收申购款	31,767.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,884.42

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

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	601390	中国中铁	2,311,218.00	2.54	重大资产重组

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	1,014	56,826.27	42,563,956.92	73.87%	15,057,879.09	26.13%
中证财通可持续发展100指数C	-	-	-	-	-	-
合计	1,014	56,826.27	42,563,956.92	73.87%	15,057,879.09	26.13%

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	5,791.83	0.01%
	中证财通可持续发展100指数C	0.00	0.00%
	合计	5,791.83	0.01%

注：(1)本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0；

(2)本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

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、基金投资和研究部门负责人	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

持有本开放式基金	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	57,524,761.74	-
本报告期基金总申购份额	3,618,426.83	-
减：本报告期基金总赎回份额	3,521,352.56	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	57,621,836.01	-

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2018年6月29日增聘武祎先生担任公司督察长职务，原督察长黄惠女士于2018年6月29日离任；

2、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

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	258,269,958.89	100.00%	187,123.79	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	2017-03-15 至 2018-6-30	33,533,869.89	0.00	0.00	33,533,869.89	58.20%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

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。

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：

(1)赎回申请延缓支付的风险

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。

(2)基金净值大幅波动的风险

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；

(3)基金规模过小导致的风险

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未有影响投资者决策的其他重要信息。

财通基金管理有限公司
二〇一八年八月二十九日