

**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2020年第4季度报告**

**2020年12月31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**

**报告送出日期:2021年01月21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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年1月20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2020年10月1日起至12月31日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 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  |
| 报告期末基金份额总额 | 142,997,264.05份  |
| 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。 |  |
| 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   |  |
| 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 | 142,997,264.05份  | 0.00份  |
| 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:(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类基金份额数为0。

### §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(2020年10月01日 - 2020年12月31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 |
| 1.本期已实现收益 | 11,725,782.81                  | 0.00            |
| 2.本期利润    | 33,143,527.31                  | 0.00            |

|                |                |        |
|----------------|----------------|--------|
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2365         | -      |
| 4.期末基金资产净值     | 266,564,213.86 | 0.00   |
| 5.期末基金份额净值     | 1.8641         | 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)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，C类份额初始净值为1.0000元；

(4)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净值表现

| 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      | 14.53%  | 1.01%     | 12.01%     | 0.98%         | 2.52%  | 0.03%  |
| 过去六个月      | 35.84%  | 1.26%     | 24.00%     | 1.29%         | 11.84% | -0.03% |
| 过去一年       | 36.01%  | 1.33%     | 18.35%     | 1.34%         | 17.66% | -0.01% |
| 过去三年       | 47.89%  | 1.23%     | 13.85%     | 1.25%         | 34.04% | -0.02% |
| 过去五年       | 63.39%  | 1.16%     | 30.21%     | 1.19%         | 33.18% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 157.01% | 1.31%     | 89.64%     | 1.40%         | 67.37% | -0.09% |

中证财通可持续发展100指数C净值表现

| 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      | 0.00%  | 0.00%     | 12.01%     | 0.98%         | -12.01% | -0.98% |
| 过去六个月      | 0.00%  | 0.00%     | 24.00%     | 1.29%         | -24.00% | -1.29% |
| 过去一年       | 0.00%  | 0.00%     | 18.35%     | 1.34%         | -18.35% | -1.34% |
| 过去三年       | 0.00%  | 0.00%     | 13.85%     | 1.25%         | -13.85% | -1.25% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.00%  | 0.00%     | 27.39%     | 1.15%         | -27.39% | -1.15% |

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





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)本基金建仓期为基金合同生效起 6 个月，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 |        |  |
| 吴迪  | 本基金的基金经理    | 2016年4月21日  | -    | 10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月加入财通基金管理有限公司，曾任战略产品部产品经理、量化投资部研究员、基金经理助理，现任量化投资一部基金经理。 |
| 朱海东 | 本基金的基金经理、量化 | 2019年7月16日  | -    | 9年     | 复旦大学理学硕士。历任银河基金量化研究员，平安资管量化投资部研究经  |

|  |                            |  |  |  |   |
|--|----------------------------|--|--|--|---|
|  | 投资一部<br>总监助理<br>（主持工<br>作） |  |  |  | 理，负责产品投资管理以<br>及量化模型开发工作。20<br>19年6月加入财通基金管<br>理有限公司，现任量化投<br>资一部总监助理（主持工<br>作）、基金经理。 |
|--|----------------------------|--|--|--|---|

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》、《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 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度，国内经济维持复苏态势，投资、消费各项数据继续回暖，出口增速超预期。海外疫情反复不断，但随着新冠疫苗的广泛接种，病毒传播速度有望得到遏制。全球货币宽松政策转向尚需时日，无风险收益率维持低位，权益市场和大宗商品价格表现亮眼。四季度，A股一路震荡上行，波动率保持在较低水平，从结构上看，以白酒为代表的消费板块延续强势，新能源、汽车和有色金属板块也实现较大涨幅。

报告期内，本基金组合采用类行业中性配置，控制行业暴露在较低范围之内，同时控制组合相对市场主流风格如大小盘、价值、成长等的暴露，采用量化模型在行业内优选个股，分散持仓，追求相对基准的长期稳定的超额收益，并在投资上积极参与新股申购，相对业绩基准创造出了超额收益。

#### 4.5 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1.8641元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为14.53%，同期业绩比较基准收益率为12.01%；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12.01%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告



## 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)          | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 252,362,807.37 | 94.32         |
|    | 其中：股票             | 252,362,807.37 | 94.32         |
| 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      | 14,589,023.51  | 5.45          |
| 8  | 其他资产              | 617,257.49     | 0.23          |
| 9  | 合计                | 267,569,088.37 | 100.00        |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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              | 7,294,379.20   | 2.74          |
| C  | 制造业              | 120,475,180.04 | 45.20         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 8,164,537.84   | 3.06          |
| E  | 建筑业              | 10,313,019.38  | 3.87          |
| F  | 批发和零售业           | 3,691,126.22   | 1.38          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 15,052,352.41  | 5.65          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 7,229,414.95   | 2.71          |
| J  | 金融业              | 41,133,178.09  | 15.43         |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| K | 房地产业          | 4,936,666.27   | 1.85  |
| 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            | 218,289,854.40 | 81.89 |

### 5.2.2 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         | 123,360.00    | 0.05         |
| B  | 采矿业              | 237,232.00    | 0.09         |
| C  | 制造业              | 23,468,975.54 | 8.80         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 158,161.00    | 0.06         |
| E  | 建筑业              | 473,779.40    | 0.18         |
| F  | 批发和零售业           | 1,583,333.60  | 0.59         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 491,728.24    | 0.18         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,812,643.62  | 0.68         |
| J  | 金融业              | 2,092,595.66  | 0.79         |
| K  | 房地产业             | 397,075.14    | 0.15         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 1,554,107.97  | 0.58         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 503,071.80    | 0.19         |
| 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   | 591,631.00    | 0.22  |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 585,258.00    | 0.22  |
| S | 综合        | -             | -     |
|   | 合计        | 34,072,952.97 | 12.78 |

### 5.2.3 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。

## 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

### 5.3.1 报告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

| 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<br>(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|------------------|
| 1  | 601633 | 长城汽车 | 209,300 | 7,913,633.00 | 2.97             |
| 2  | 002142 | 宁波银行 | 196,399 | 6,940,740.66 | 2.60             |
| 3  | 601166 | 兴业银行 | 318,400 | 6,645,008.00 | 2.49             |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 3,258   | 6,509,484.00 | 2.44             |
| 5  | 601919 | 中远海控 | 503,200 | 6,144,072.00 | 2.30             |
| 6  | 000858 | 五粮液  | 19,719  | 5,754,990.15 | 2.16             |
| 7  | 600104 | 上汽集团 | 194,499 | 4,753,555.56 | 1.78             |
| 8  | 000625 | 长安汽车 | 233,645 | 4,649,535.50 | 1.74             |
| 9  | 000333 | 美的集团 | 42,210  | 4,155,152.40 | 1.56             |
| 10 | 600031 | 三一重工 | 115,138 | 4,027,527.24 | 1.51             |

### 5.3.2 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

| 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  | 600036 | 招商银行 | 23,300  | 1,024,035.00 | 0.38         |
| 2  | 601658 | 邮储银行 | 178,300 | 852,274.00   | 0.32         |
| 3  | 601799 | 星宇股份 | 4,000   | 802,000.00   | 0.30         |
| 4  | 688169 | 石头科技 | 700     | 725,200.00   | 0.27         |
| 5  | 603301 | 振德医疗 | 11,400  | 712,842.00   | 0.27         |

## 5.4 报告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。

## 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 5.6 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

**5.11.1 报告期内**，本基金投资的前十名证券的宁波银行（证券代码：002142.SZ）因设立时点性规模考核指标，股权质押管理不合规，收到宁波银保监局行政处罚。本基金投资的前十名证券的兴业银行（证券代码：601166.SH）因违反《征信业管理条例》第四十条的规定，未按照规定处理异议，收到中国人民银行重庆营业管理部公开处罚。**除上述**

情况外，本基金投资的其他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。

本基金投资上述标的的投资决策程序为：

- 1、投资决策委员会确定每个产品的基本投资逻辑；
- 2、投资研究体系中的研究平台是一个共享平台，为投资决策全流程提供研究支持；
- 3、基金经理拟订所管理产品的投资计划与方案；
- 4、金融工程小组对基金经理/投资经理的投资计划进行风险评价，并向投资决策委员会提交评估报告；
- 5、投资决策委员会对基金经理/投资经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要；
- 6、根据决策纪要，基金经理/投资经理对计划方案进行具体实施；
- 7、中央交易室按有关交易规则执行基金经理/投资经理下达的交易指令，并将有关信息进行反馈；
- 8、基金经理/投资经理定期检讨投资组合的运作成效；
- 9、金融工程小组定期为投资决策委员会、投资总监、基金经理/投资经理出具绩效与风险评估报告。

**5.11.2 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。**

**5.11.3 其他资产构成**

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 139,600.42 |
| 2  | 应收证券清算款 | 460,887.80 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 3,511.28   |
| 5  | 应收申购款   | 13,257.99  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 617,257.49 |

**5.11.4 报告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。

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

**5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 000625 | 长安汽车 | 4,649,535.50   | 1.74         | 非公开发行锁定  |

#### 5.11.5.2 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。

#### 5.11.6 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

|                               | 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 |
|-------------------------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额                   | 139,954,234.31  | -               |
| 报告期期间基金总申购份额                  | 7,897,582.80    | -               |
| 减：报告期期间基金总赎回份额                | 4,854,553.06    | -               |
| 报告期期间基金拆分变动份额<br>(份额减少以“-”填列) | -               | -               |
| 报告期期末基金份额总额                   | 142,997,264.05  | -               |

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。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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 |
|------------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 1,828,670.63    | -               |
| 报告期期间买入/申购总份额    | -               | -               |
| 报告期期间卖出/赎回总份额    | 1,828,670.63    | -               |
| 报告期期末管理人持有的本基金份  | -               | -               |

|                           |   |   |
|---------------------------|---|---|
| 额                         |   |   |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | - | - |

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期        | 交易份额 (份)     | 交易金额(元)      | 适用费率 |
|----|------|-------------|--------------|--------------|------|
| 1  | 申购   | 2015年07月08日 | 1,828,670.63 | 3,000,000.00 | 0.4% |
| 2  | 赎回   | 2020年10月13日 | 1,828,670.63 | 3,117,883.42 | 0    |
| 合计 |      |             | 3,657,341.26 | 6,117,883.42 |      |

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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              | 2020-1-21 至 2020-12-31  | 39,537,390.72 | 0.00 | 0.00 | 39,537,390.72 | 27.65% |
| 机构  | 2              | 2020-4-27 至 2020-12-31  | 32,668,409.02 | 0.00 | 0.00 | 32,668,409.02 | 22.85% |
| 机构  | 3              | 2020-4-27 至 2020-12-31  | 32,226,232.68 | 0.00 | 0.00 | 32,226,232.68 | 22.54% |
| 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。本基金可以投资科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括流动性风险、退市风险和投资集中风险等。</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> |                |                         |               |      |      |               |        |

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。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，在《证券日报》及管理人网站进行了如下信息披露：

1、2020年10月24日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告》；

2、2020年10月27日披露了《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2020年第三季度报告》；

3、2020年11月6日披露了《财通基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法人员假冒财通基金名义实施非法证券行为的公告》；

4、2020年12月15日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加信达证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

5、2020年12月17日披露了《财通基金管理有限公司关于修订旗下部分公募基金基金合同的公告》；

6、2020年12月17日披露了《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合同》；

7、2020年12月17日披露了《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托管协议》；

8、2020年12月17日披露了《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产品资料概要更新》；

9、2020年12月17日披露了《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更新招募说明书》；

10、2020年12月31日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2021倾心回馈”基金定期定额申购费率优惠活动的公告》；

11、2020年12月31日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》；

12、本报告期内，公司按照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》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、关于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合同；



3、关于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托管协议；

4、关于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。

## 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  
二〇二一年一月二十一日