

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2013年年度报告

2013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

送出日期：2014年03月29日

§1 重要提示及目录

1.1 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的法律责任。本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2014年3月26日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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2013年3月22日（基金合同生效日）起至12月31日止。

1.2 目录

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	21
§5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	21
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	21
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	22
§6 审计报告	22
6.1 审计报告基本信息	22
§7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表	23
7.2 利润表	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	26
7.4 报表附注	27
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	51
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
8.6 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	64
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	64
8.8 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	64
8.9 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	65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65

8.12 投资组合报告附注.....	65
§9 基金份额持有人信息.....	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
§10 开放式基金份额变动.....	67
§11 重大事件揭示.....	67
11.1 基金份额持有人大会决议.....	67
11.2 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.....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
11.4 基金投资策略的改变.....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况.....	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
11.8 其他重大事件.....	68
§12 备查文件目录.....	70
12.1 备查文件目录.....	70
12.2 存放地点.....	71
12.3 查阅方式.....	71

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	中证财通可持续发展100指数
基金主代码	000042
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	66,317,901.24份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	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。 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%。
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。

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	黄惠	夏虹
	联系电话	021-68886666	021-68475682
	电子邮箱	service@ctfund.com	xiahong@bankofshanghai.com
客户服务电话		400-820-9888	95594
传真		021-68888321	021-68475623
注册地址		上海市虹口区吴淞路619号 505室	上海市银城中路168号
办公地址		上海市浦东新区银城中路68 号时代金融中心41楼	上海市银城中路168号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		阮琪	范一飞

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ctfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
注册登记机构	财通基金管理有限公司	上海市银城中路68号时代金融中心41楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2013年03月22日（基金合同生效日）-2013年12月31日
本期已实现收益	641,314.76
本期利润	-1,960,518.85
加权平均基金份额本期利润	-0.0194
本期加权平均净值利润率	-1.98%
本期基金份额净值增长率	-5.50%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末
期末可供分配利润	-3,629,424.63
期末可供分配基金份额利润	-0.0547
期末基金资产净值	62,688,476.61
期末基金份额净值	0.945
3.1.3 累计期末指标	2013年末
基金份额累计净值增长率	-5.50%

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。

(4)本基金的《基金合同》生效日为2013年3月22日，至本报告期末未满三年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至2013年12月31日的数据。

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

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
过去三个月	-3.08%	1.03%	-2.63%	1.04%	-0.45%	-0.01%
过去六个月	4.54%	1.13%	5.38%	1.20%	-0.84%	-0.07%
自基金合同生效日起至今（2013年03月22	-5.50%	1.06%	-12.82%	1.23%	7.32%	-0.17%

日-2013年12月31日)						
----------------	--	--	--	--	--	--

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%。

3.2.2 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

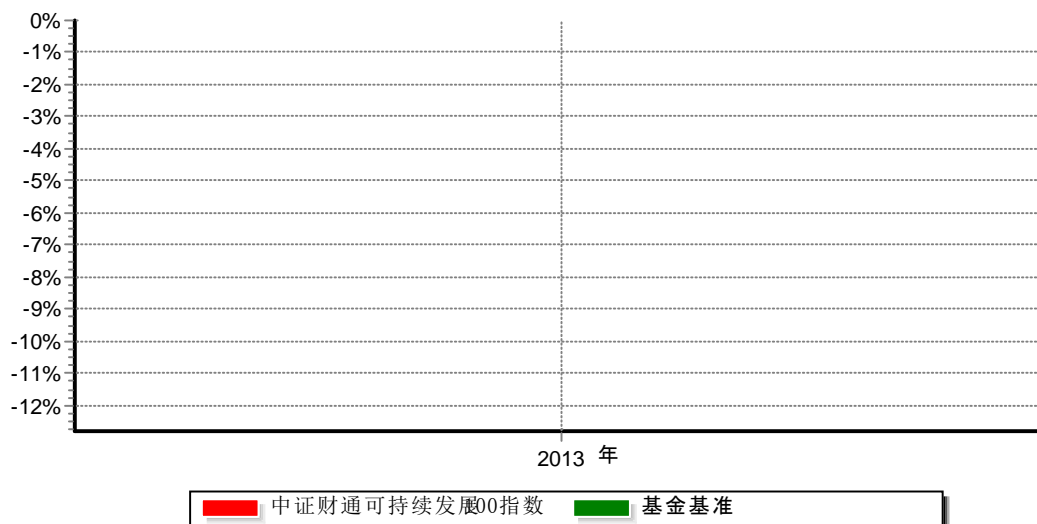
中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数增强型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2013年03月22日-2013年12月31日）



注：（1）本基金合同生效日为2013年3月22日，基金合同生效起至披露时点不满一年；

（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；截至建仓期末和报告期末，基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：（1）本基金合同生效日为2013年3月22日，基金合同生效起至披露时点不满一年，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算；

（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；截至建仓期末和报告期末，基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金的《基金合同》生效日为2013年3月22日，截至2013年12月31日，本基金未进行过利润分配。

§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升华拜克生物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、永安系列等多个子品牌，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80余人，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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
关家雄	本基金的基金经理、量化投资部总监助理	2013年03月22日	—	7年	厦门大学金融数学专业硕士。7年基金从业经历，4年投资经验，历任宝盈基金管理有限公司专户投资经理，金融工程研究员。2011年加入财通基金管理有限公司，曾任高级研究员、投资经理，现任量化投资部总监助理。

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》、《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 公平交易制度和控制方法

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。

本公司现行公平交易制度主要内容附录如下：

第一条 为了进一步规范和完善财通基金管理有限公司（以下简称“公司”）有关授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等业务管理，保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，特制订本制度。

第二条 本制度根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规以及公司管理制度制订。

第三条 本制度所称投资组合包括封闭式基金、开放式基金、社保组合、企业年金、特定客户资产管理组合等。

第四条 公司应严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

第五条 本制度以保证公司旗下管理的不同投资组合之间不存在利益输送并得到公平对待，以及保护投资者合法权益为基本原则而制订。

第六条 本制度规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

第七条 公司应合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

第八条 公司应建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，应通过对投资交易行为的

监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

第九条 公司研究员负责各行业上市公司的调研及研究报告的撰写，采用客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据。

公司内部建立信息公开、资源共享的公平投资管理环境。内部研究报告由行业研究员上传公司研究平台，各投资组合经理可以在同一时间接收到同样的研究信息及个股评估，对自身管理的组合做出适当的投资决定，不存在个别组合获得信息落后或不全面的情况。

第十条 公司建立健全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上，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，按需要建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合。

第十一条 公司执行健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分。

第十二条 公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息应相互隔离。

第十三条 公司建立系统的交易方法，即投资组合经理应根据投资组合的投资风格和投资策略，制定客观、完整的交易决策规则，并按照这些规则进行交易决策，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。

第十四条 公司要求投资组合经理承诺并落实严格遵守基金合同、特定资产管理合同及公司有关投资管理制度的规定，审慎勤勉，充分发挥专业判断能力，不受他人干预，在授权范围内独立行使投资决策权，维护公平的投资管理环境，维护所管理投资组合的合法利益，并按照规则进行交易决策，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性，坚持投资者利益优先的原则。

第十五条 集中交易部与投资、研究部门严格实行物理隔离，以充分保障集中交易部的独立性与保密性，实行集中交易制度，同时建立和完善公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

第十六条 投资交易系统支持公平交易功能，不同投资组合同向买卖同一证券的交易分配原则为“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”。

第十七条 严格禁止同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为。但完全按照有关指数构成比例进行证券投资的投资组合可以不受此规定的限制。

第十八条 所有投资对象的投资指令必须经由集中交易部负责人或其授权人审核分

配至交易员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待，应保证不同投资组合在同一时点就同一投资对象下达的相同方向的投资指令分配给同一交易员完成。

第十九条 对于交易所公开竞价交易，公司在投资交易系统设置强制公平交易模式，系统遇到该类两个或两个以上不同投资组合发出同向买卖指令情形时，会自动提示交易员进入公平交易模式。该模式下，在两个或两个以上投资组合的指令有效价格范围内，系统能最大限度保证参加公平交易的各投资组合所买入或卖出投资对象的价格接近。各投资组合参加公平交易委托数量按照各投资组合中尚未执行指令部分的委托数量占公平交易委托总量的比例进行分配。各投资组合指令在无交易员人为干预的情况下，各自在交易所完成交易指令。

第二十条 公司要求同一投资组合经理对其名下管理的各投资组合进行绝对公平交易执行。即同一投资组合经理如需下达同一只投资对象的买卖交易指令时，其所管理投资组合的所有有关指令必须是同时间、同限价批量下达，但数量可以按投资组合的规模而有所不同。

第二十一条 公司要求不同投资组合经理对其名下管理的各投资组合进行相对公平交易执行。即不同的投资组合经理基于平等的信息知晓权和所管理投资组合的个别情况，分别独立做出对某一投资对象的投资决策，故下达指令的时间、限价都会有所不同。但由于是共同享有同一信息来源，不同投资组合经理在同一天就同一投资对象下达的买卖交易指令应为同向交易，限价范围比较接近但可以不同，指令的数量也可按组合的规模而有所不同。

第二十二条 投资组合经理不得为了影响股票交易价格在交易日 14:50-15:00 间下达交易所投资指令，如因为申购、赎回或合规控制的要求需在交易日 14:50-15:00 间下达交易所投资指令，投资经理必须使用录音电话通知集中交易部相关情况，并于当日收盘后及时提交书面情况说明，由集中交易部、监察稽核部和投资相关部门备案。

第二十三条 对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量。公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配，申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。集中交易部必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格与数量等要素。

第二十四条 对于各投资组合以独立账户名义进行申购的交易，申购获配的证券数量由投资交易系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。

第二十五条 对于由于特殊原因不能参与公平交易程序的交易指令，按照公司已建立的相应控制制度和流程执行。

第二十六条 为确保公司管理的不同投资组合获得公平对待，确保投资管理和交易管理业务的合法合规和公平诚信，公司建立异常交易的监控和报告制度。

第二十七条 根据监管机关和证券交易所的相关规定，主要的异常交易类型包括：涉嫌内幕交易的投资交易行为、涉嫌市场操纵的投资交易行为、涉嫌利益输送的投资交易行为等。

(一) 涉嫌内幕交易的投资交易行为是指根据能够影响股价和投资者投资行为的重大非公开信息进行投资的行为；

(二) 涉嫌市场操纵的投资交易行为是指公司管理的投资组合的交易行为致使证券交易价格发生异常或形成虚拟的价格水平，或者致使证券交易量发生异常或形成虚拟的交易量水平。其主要的类型包括：

1、连续交易操纵。即公司管理的投资组合单独或者通过合谋，集中资金优势、持股优势或者利用信息优势，联合或者连续进行买卖，操纵证券交易价格或证券交易量的行为；

2、约定交易操纵。即公司管理的投资组合相互串通，或与他人串通，以事先约定的时间、价格和方式相互进行证券交易，操纵证券交易价格或证券交易量的行为；

3、虚假申报操纵。即公司管理的投资组合进行不以成交为目的的频繁申报和撤销申报，误导其他投资者，操纵证券交易价格或交易量的行为；

4、特定时间价格操纵。即公司管理的投资组合在计算相关证券的参考价格或结算价格或参考价值的特定时间，通过拉抬、打压或锁定手段，操纵相关证券的参考价格或结算价格或参考价值的行为；

5、尾市交易操纵。即公司管理的投资组合在即将收市时，通过拉抬、打压或锁定手段，操纵证券收市价格的行为。

(三) 涉嫌利益输送的投资交易行为是指公司管理的同一投资组合的同向与反向交易、不同投资组合的同向与反向交易等存在利益输送和不符合公平交易原则的行为。

第二十八条 涉嫌内幕交易的投资交易行为的界定标准主要为：

(一) 投资组合经理或者研究人员获得的是涉及上市公司的经营、财务或者对该证券的市场价格和投资者行为有重大影响的而又尚未公开的信息；

(二) 投资组合经理的投资行为主要依据该信息，无其他充足、深入的研究支持。

第二十九条 连续交易操纵的界定标准主要为：

(一) 公司管理的单个投资组合或多个投资组合在同一个交易日内就同一证券大笔下单、连续下单或者密集下单（如多个组合同时下单），造成证券交易价格波动达到一定幅度；

(二) 公司管理的单个投资组合或多个投资组合进行巨额交易量的申报，且申报价格明显偏离申报时的成交价格达到一定幅度；

(三) 公司管理的单个投资组合或多个投资组合在一段时期内进行大量且连续的交易,造成证券交易价格发生明显波动达到一定幅度;

(四) 公司管理的单个投资组合或多个投资组合在可进行T+0 交易的市场中在同一价位或者相近价位大量或者频繁进行回转交易;

(五) 公司管理的单个投资组合或多个投资组合在大宗交易中进行涉嫌虚假申报或其他扰乱市场秩序的申报;

(六) 公司管理的单个投资组合或多个投资组合在银行间债券交易等议价交易中的成交价格明显偏离同期市场平均成交价格。

第三十条 约定交易操纵的界定标准主要为:公司管理的投资组合之间互为对手方。

第三十一条 虚假申报操纵的界定标准主要为:公司管理的投资组合在一个交易日内频繁申报或撤销申报,以影响证券交易价格或其他投资者的投资行为。

频繁申报和撤销申报,是指某投资组合在同一交易日内,在同一证券的有效竞价范围内,按照同一买卖方向,连续、交替进行三次以上的申报和撤销申报。

第三十二条 特定时间价格操纵和尾市价格操纵的界定标准主要为:在计算相关证券的参考价格或结算价格或参考价值的特定时间,如证券交易所收市前的十分钟时间,公司管理的投资组合以高于市价的价格发出买入申报致使证券交易价格发生异常上涨,或者以低于市价的价格发出卖出申报致使证券交易价格发生异常下跌,或者通过发出买入或者卖出申报致使证券交易价格发生异常波动。

第三十三条 涉嫌利益输送的投资交易行为的界定标准主要为:

(一) 公司管理的不同投资组合之间存在以对方为交易对手的交易,或者在银行间债券交易市场等议价市场上通过第三方进行利益输送的行为。

(二) 公司同一投资组合经理所管理的不同投资组合在同一交易日内存在就同一证券的无合理理由的反向交易行为。

第三十四条 本制度界定的可能影响证券交易价格或者证券交易量的异常交易行为具体包括:

(一) 各交易所交易规则中规定的、公司可能参与的异常交易行为:

- 1、可能对证券交易价格产生重大影响的信息披露前,大量买入或者卖出相关证券;
- 2、公司管理的投资组合之间大量或者频繁进行互为对手方的交易;
- 3、两个或两个以上固定的或涉嫌关联的证券账户之间大量或者频繁进行互为对手方的交易;
- 4、大笔申报、连续申报或者密集申报,以影响证券交易价格;
- 5、频繁申报或频繁撤销申报,以影响证券交易价格或其他投资者的投资行为;
- 6、在同一价位或者相近价位大量或者频繁进行回转交易;

- 7、大量或者频繁进行高买低卖交易；
- 8、进行与自身公开发布的投资分析、预测或建议相背离的证券交易；
- 9、在大宗交易中进行虚假或其他扰乱市场秩序的申报；
- 10、其他经交易所或托管银行电话、书面提示的交易异常行为。

(二) 银行间询价交易包括的异常交易行为：

1、交易对手异常：指交易对手超出交易对手库范围、与信用级别较低的交易对手进行大额交易、与丙类账户进行交易；

2、交易价格异常：指回购利率异常和现券交易价格异常。回购利率异常指回购利率偏离同期公允回购利率（可参考中债登网站提供的回购利率数据）30bp

以上，现券交易价格异常指根据交易价格推算出的收益率偏离同期公允收益率（根据影子定价标准确定）30bp 以上（一年期以上债券为50bp）；

3、同日反向交易：指当天买卖同一债券品种且价格相同（或造成亏损）的交易、当天进行利率相同（或造成亏损）的正逆回购交易等。

(三) 其他涉嫌进行利益输送的交易行为：

- 1、关联交易行为；
- 2、投资于禁止或者限制的投资对象；
- 3、与受限或禁止的交易对手进行交易；
- 4、采用可能显著影响市价的交易方式；
- 5、可能违反公平交易原则的交易；
- 6、与投资组合的投资风格或公司内部的投资分析明显不符的交易行为。

(四) 公司规定的其他异常交易行为。

第三十五条 异常交易监控体系包括事前监控、事中监控、事后监控三个环节。

第三十六条 事前监控是指在投资交易系统中进行风险监控参数设置及风险监控参数调整，此项工作由风险管理部负责。

第三十七条 在新投资组合成立并开始运作前，根据法律法规、基金合同、资产管理合同、公司规章制度及公司相关决定，风险管理部应及时编制《风险控制参数设置表》，经督察长批准后进行设置。

第三十八条 《风险控制参数设置表》应包括政策性指标、契约性指标、内部监控指标三个方面。政策性指标、契约性指标必须与法律法规、监管政策和各类资产管理合同的相关规定严格一致。非因法律法规、监管政策和资产管理合同发生调整 and 变化，风险管理部不得接受任何关于取消、放宽政策性指标、契约性指标的要求。对于内部监控指标，公司规章制度已明确规定放开监控、放宽监控程序的，风险管理部应在严格审核程序完整性、有效性的前提下执行放开、放宽监控的操作。

第三十九条 风险管理部应对日常交易中系统自动触发的限制性投资交易行为予以监控和报告。

第四十条 事中监控是指投资交易过程中对异常交易的实时监控，包括指令时间、价格、数量等方面。集中交易部负有对系统无法识别和限制的异常交易进行监控和报告的职责。

第四十一条 事后监控包括公平交易分析、交易情况稽核两项内容，分别由风险管理部、监察稽核部负责。

第四十二条 集中交易部在收到下述情形之一的投资指令时启动异常交易识别流程和报告制度。启动异常交易识别流程后，涉及异常交易的投资指令暂停执行：

- (一) 交易所投资指令当日累计数量已达到所投资股票当日成交量的50%的；
- (二) 交易所投资指令下达时间距离收市10 分钟以内的；
- (三) 短时间内针对同一证券频繁下达指令或者频繁撤销指令的；
- (四) 同一投资组合经理投资某一证券，对其管理的投资风格相似的各投资组合下达投资指令时，存在不合理时间或价格差异；
- (五) 议价交易的交易对手方为公司股东、投资组合托管人或其重大利益关联方、议价交易对手库以外的交易对象；
- (六) 参与开盘集合竞价时，投资指令价格偏离前一交易日收盘价格5%（含）以上的；
- (七) 其他可能影响到公平交易或可能发生利益输送的。

第四十三条 涉及异常交易的投资指令，由集中交易部要求指令下达人填写《特殊交易需求申请审批表》，指令下达人做出合理性解释，经由相关部门审核通过并报集中交易部、风险管理部备案。审核流程中任一人员认为有必要的，应当要求其他相关人员提供意见。

第四十四条 风险管理部对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易原则的要求。

第四十五条 风险管理部应根据市场公认的第三方信息，对投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查。相关投资组合经理应对交易价格异常情况进行合理性解释。

第四十六条 风险管理部对不同投资组合，尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

第四十七条 风险管理部应对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析。

相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

第四十八条 公司建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，并健全相关业务记录，确保投资交易公平性的可稽核性。

第四十九条 投资交易行为稽核工作应包括如下内容：

- (一) 投资交易系统风险控制参数的健全性、完整性、有效性；
- (二) 投资指令、指令分配、交易执行的合法合规性；
- (三) 公平交易分析及专项报告的合法合规性。

第五十条 监察稽核部对投资交易行为的稽核工作应反映在季度监察稽核项目表中以及相关专项稽核报告中。

第五十一条 督察长负责对整个投资交易业务领域事前、事中、事后的监控情况实施检查和监督。

第五十二条 在监控过程中集中交易部、风险管理部、监察稽核部一旦发现异常交易，应立即向公司督察长、分管副总经理及总经理报告，并及时采取相关的控制和改进措施。

第五十三条 经报告的异常交易行为，由监察稽核部负责进行专项稽核。监察稽核部应查明该事项的发生过程、发生原因、责任人、处理建议，形成报告后报送督察长、分管副总经理、总经理审批。

第五十四条 风险管理部负责交易价差分析。交易价差是指不同投资组合在相同的时间段内同买或者同卖一只股票时两者买卖均价存在差异。

第五十五条 交易价差分析应遵循如下原则：

(一) 分别计算各个投资组合同期、同方向交易的某只股票的交易均价，然后比较各自均价差异，再将发生的所有差异进行汇总分析；

(二) 模拟计算各投资组合之间溢价金额大小，分析利益输送的可能性。

第五十六条 风险管理部建立分析交易价差的信息系统，应对不同投资组合和不同类别投资组合之间的交易价差进行分析，尤其是对于那些与其他投资组合收益率存在明显差异的投资组合重点进行交易价差分析。

第五十七条 风险管理部应分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

第五十八条 在各投资组合的定期报告中，至少应披露以下事项：公司整体公平交

易制度执行情况；对异常交易行为做专项说明，其中，如果报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%，应说明该类交易的次数及原因。

在投资组合的年度报告中，还应披露公平交易制度和控制方法，并在公司整体公平交易制度执行情况中，对当年度同向交易价差做专项分析。

第五十九条 公司应参考交易所和托管银行的提示进行信息披露。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3 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。本期未进行场外交易。

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，本期内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

过去的2013年，是中国经济转型的关键年，改革及变化成了全年的主题。经济改革顶层设计、大范围反腐、紧张的中日关系和严重的“钱荒”都影响着中国宏观经济和资本市场。但从整体来看，2013年的宏观经济运行基本平稳，GDP增长7.7%，符合年初政府制定的工作目标，可控、稳健的改革是2013年经济和政府宏观政策的主线。

全年A股市场弱势宽幅震荡，主要蓝筹指数表现为震荡下跌，我们在报告期内采取被动跟踪和量化增强相结合的投资策略，在合理控制跟踪误差的同时，获得了较高的超额收益，业绩在增强型指数基金中排名前列。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年，中证财通中国可持续发展100（ECPI ESG）指数（以下简称“ESG100指

数”) 全年下跌12.71%。本基金成立于2013年3月22日, 成立以来至本报告期末, 本基金收益率下跌5.50%, 业绩比较基准收益率下跌12.82%, 跑赢业绩比较基准7.32%, 实现了合理跟踪, 良好增强的投资目标。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年将是改革全面推进期, 我们认为政府仍将持续实施可控、稳健的改革步骤。通过反腐倡廉、法制建设、共同治理等正面效应, 适度宽松的货币政策, 整体保障经济稳健运行, 逐步贯彻经济结构转型, 落实土地改革、金融改革、国资改革、破除垄断、城镇化等改革政策, 改革的短期冲击会持续, 但中长期意义显著。

2014年初资金流动性小幅宽裕的状态将会持续到两会前后, 前期杀跌的低估值品种和业绩增速回升明显的行业将获得持续反弹收益。ESG100指数作为低估值的代表性指数, 可以作为配置的首选。而从中长期的改革方向来看, 国企改革的目的就是为了提升公司治理能力和注重长期经济效益, ESG指数中的良好国企标的将会受益。

因此, 我们将继续坚持被动投资为主, 量化增强为辅的投资策略, 为投资者选择良好的可持续发展投资标的, 并在此基础上为投资者提供适当的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内, 本基金管理人依照国家相关法律法规和公司内部管理制度全面深入推进监察稽核各项工作。公司监察稽核部门在权限范围内, 对公司各部门执行公司内控制度及各项规章制度情况进行监察, 对公司各项业务活动与相关制度等的合法性、合规性、合理性进行监督稽核、评价、报告和建议。通过各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法, 对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核, 发现问题及时提出改进建议, 并督促相关部门进行整改, 同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训, 开展了多次培训活动, 加强对员工行为的管理, 增强员工合规意识。公司还通过网站、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。

本报告期内, 本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规, 有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 建立健全风险管理体系, 进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性, 最大限度地防范和化解经营风险, 充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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《关于进一步规范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（以下简称“中国工商银行”）于2013年9月签订了《基金估值核算业务外包协议》，拟将基金管理人的证券投资基金、特定多个客户资产管理计划或特定单一资产管理计划的信息披露、会计核算和估值业务服务外包给中国工商银行，截至报告期末，基金管理人仅对旗下两只特定资产管理计划估值业务实行外包。

4.8 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。

§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、《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》和《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》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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2014）审字第60951782_B04号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的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财务报表，包括2013年12月31日的资产负债表和2013年3月22日（基金合同生效日）至2013年12月31日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人财通基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准

资产：		
银行存款	7.4.7.1	3,055,469.91
结算备付金		90,456.13
存出保证金		112,908.18
交易性金融资产	7.4.7.2	58,259,367.05
其中：股票投资		58,259,367.05
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	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,500,000.00
应收证券清算款		141,843.66
应收利息	7.4.7.5	962.90
应收股利		—
应收申购款		2,277.42
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		63,163,285.25
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013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		99,977.45
应付赎回款		—
应付管理人报酬		55,086.24
应付托管费		8,262.93
应付销售服务费		—

应付交易费用	7.4.7.7	21,482.02
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	290,000.00
负债合计		474,808.64
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	66,317,901.24
未分配利润	7.4.7.10	-3,629,424.63
所有者权益合计		62,688,476.61
负债和所有者权益总计		63,163,285.25

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2013年12月31日，基金份额净值0.945元，基金份额总额66,317,901.24份。

(3) 本基金成立于2013年3月22日，无上年度可比期间，因此资产负债表只列示从基金合同生效日至2013年12月31日数据，特此说明。

7.2 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：2013年03月22日至2013年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2013年03月22日至2013年12月31日
一、收入		-143,358.70
1.利息收入		765,791.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	103,376.01
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		662,415.73
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,461,447.39
其中：股票投资收益	7.4.7.12	95,901.83

基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	—
资产支持证券投资收益		—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	7.4.7.14	—
股利收益	7.4.7.15	1,365,545.56
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-2,601,833.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	231,235.78
减：二、费用		1,817,160.15
1. 管理人报酬		769,632.45
2. 托管费		115,444.88
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	7.4.7.18	539,998.79
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	7.4.7.19	392,084.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,960,518.85
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,960,518.85

注：(1)后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(2) 本基金成立于2013年3月22日，无上年度可比期间，因此利润表只列示从基金合同生效日至2013年12月31日数据，特此说明。

7.3 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：2013年03月22日至2013年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2013年03月22日至2013年12月31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)	247,395,794.87	—	247,395,794.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-1,960,518.85	-1,960,518.85
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)	-181,077,893.63	-1,668,905.78	-182,746,799.41
其中：1.基金申购款	2,275,069.23	-34,645.73	2,240,423.50
2.基金赎回款	-183,352,962.86	-1,634,260.05	-184,987,222.91
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)	66,317,901.24	-3,629,424.63	62,688,476.61

注：本基金成立于2013年3月22日，无上年度可比期间，因此所有者权益变动表只列示从基金合同生效日至2013年12月31日数据，特此说明。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

刘未

刘未

罗瑞宏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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%

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“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的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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。

7.4.3 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2013年12月31日的财务状况以及2013年3月22日（基金合同生效日）至2013年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。比较财务报表的实际编制期间为2013年3月22日(基金合同生效日)至2013年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债；

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1)股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(2)债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

(3)权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于交易日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

(5)回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值。

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值。

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算。

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值。

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值。

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理。

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最

近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述2)、3)中的相关原则进行估值。

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入

账；

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的1.00%的年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率逐日计提；

(3)基金标的指数许可使用费，通常情况下按前一日的基金资产净值的0.016%的年费率逐日计提，收取下限为每季度人民币5万元；

(4)卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5)其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)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；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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、国家税务总局财税字[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. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄

利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

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；

根据财政部、国家税务总局财税字[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、国家税务总局财税字[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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日
活期存款	3,055,469.91
定期存款	—
其他存款	—
合计	3,055,469.91

注：(1)本基金本报告期末未投资于定期存款；

(2) 本基金成立于2013年3月22日，无上年度可比期间数据。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	60,861,200.66	58,259,367.05	-2,601,833.61
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—

债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		60,861,200.66	58,259,367.05	-2,601,833.61

注：本基金于2013年03月22日成立，因此无上年度可比期间数据，特此说明。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	
	本期末账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,500,000.00	—
合计	1,500,000.00	—
合计	—	—

注：本基金于2013年03月22日成立，因此无上年度可比期间数据，特此说明。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日
应收活期存款利息	862.25
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—

应收结算备付金利息	44.77
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	55.88
合计	962.90

注：本基金于2013年03月22日成立，因此无上年度可比期间数据，特此说明。

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日
交易所市场应付交易费用	21,482.02
银行间市场应付交易费用	—
合计	21,482.02

注：本基金于2013年03月22日成立，因此无上年度可比期间数据，特此说明。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提费用	290,000.00
合计	290,000.00

注：本基金于2013年03月22日成立，因此无上年度可比期间数据，特此说明。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2013年03月22日（基金合同生效日）至2013年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	247,395,794.87	247,395,794.87
本期申购	2,275,069.23	2,275,069.23
本期赎回（以“-”号填列）	-183,352,962.86	-183,352,962.86
本期末	66,317,901.24	66,317,901.24

注：(1)本期申购含红利再投、转换入份额，本期赎回含转换出份额；

(2) 本基金合同于2013年3月22日生效。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。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	641,314.76	-2,601,833.61	-1,960,518.85
本期基金份额交易产生的变动数	-812,864.94	-856,040.84	-1,668,905.78
其中：基金申购款	33,868.49	-68,514.22	-34,645.73
基金赎回款	-846,733.43	-787,526.62	-1,634,260.05
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-171,550.18	-3,457,874.45	-3,629,424.63

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2013年03月22日至2013年12月31日
活期存款利息收入	76,298.14
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	24,540.33

其他	2,537.54
合计	103,376.01

注：本基金于2013年03月22日成立，因此无上年度可比期间数据，特此说明。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年03月22日至2013年12月31日
卖出股票成交总额	184,191,951.82
减：卖出股票成本总额	184,096,049.99
买卖股票差价收入	95,901.83

注：本基金于2013年03月22日成立，因此无上年度可比期间数据，特此说明。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年03月22日至2013年12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	—
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	—
减：应收利息总额	—
债券投资收益	—

注：(1)本基金于2013年03月22日成立，因此无上年度可比期间数据，特此说明；

(2)本基金本报告期内债券收益为零。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年03月22日至2013年12月31日
----	-------------------------------

卖出权证成交总额	—
减：卖出权证成本总额	—
买卖权证差价收入	—

注：(1)本基金于2013年03月22日成立，因此无上年度可比期间数据，特此说明；

(2)本基金本报告期内衍生工具收益为零。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年03月22日至2013年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,365,545.56
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,365,545.56

注：本基金于2013年03月22日成立，因此无上年度可比期间数据，特此说明。

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013年03月22日至2013年12月31日
1.交易性金融资产	-2,601,833.61
——股票投资	-2,601,833.61
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	-2,601,833.61

注：本基金于2013年03月22日成立，因此无上年度可比期间数据，特此说明。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2013年03月22日至2013年12月31日
基金赎回费收入	231,235.78
合计	231,235.78

注：(1)本基金赎回费总额的25%归入基金资产；

(2)本基金的转换费由转出基金赎回费和转入基金申购补差费构成，其中赎回费部分的25%归入基金资产；

(3) 本基金于2013年03月22日成立，因此无上年度可比期间数据，特此说明。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2013年03月22日至2013年12月31日
交易所市场交易费用	539,998.79
银行间市场交易费用	—
合计	539,998.79

注：本基金于2013年03月22日成立，因此无上年度可比期间数据，特此说明。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2013年03月22日至2013年12月31日
审计费用	60,000.00
信息披露费	180,000.00
帐户维护费	900.00
汇划手续费	207.89
指数使用费	150,976.14
合计	392,084.03

注：本基金于2013年03月22日成立，因此无上年度可比期间数据，特此说明。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至2013年12月31日止，本基金未发生需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
杭州市实业投资集团有限公司	基金管理人的股东
浙江升华拜克生物股份有限公司	基金管理人的股东
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
上海财通资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期与关联方未产生佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年03月22日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	769,632.45
其中：支付销售机构的	181,572.30

客户维护费	
-------	--

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；

(4)本基金于2013年3月22日成立，无比较式的上年度可比期间。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年03月22日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	115,444.88

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；

(3)本基金于2013年3月22日成立，无比较式的上年度可比期间。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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未投资本基金。

7.4.10.5 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 2013年03月22日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
上海银行活期存款	3,055,469.91	76,298.14

注：(1) 本基金于2013年03月22日成立，因此无上年度可比期间数据，特此说明。

(2)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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项的说明。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发的流通受限证券。

7.4.12.2 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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600058	五矿发展	2013-07-24	重大事项	13.56	2014-01-06	14.92	41,065	568,399.47	556,841.40	-
000600	建投能源	2013-12-31	重大事项	4.47	2014-01-06	4.45	33,000	130,350.00	147,510.00	-
000562	宏源证券	2013-10-30	重大事项	8.22	-	-	57,794	578,523.71	475,066.68	

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的管理人进行风险管理的主要目标是加强对投资风险防范和控制，保证基金资产的安全，维护基金份额持有人的利益；同时，提升基金投资组合的风险调整后收益水平，将以上各种风险控制在限定的范围之内，在基金的风险和收益之间取得最佳的平衡，实现“风险和收益相匹配”的投资目标，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会下设合规控制委员会，负责对公司风险管理战略和政策、内部控制及风险控制基本制度进行审定，对基本制度的执行情况、关联交易的合法合规性等进行监督和检查。董事会聘任督察长，负责公司及其基金运作的监察稽核工作。总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作，公司下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。公司各业务部门根据具体情况制定本部门的作业流程及风险控制制度，加强对风险的控制，作为一线责任人，将风险控制在最小范围内。同时，公司设独立的监察稽核部和风险管理部，两者依各自职能对公司运作各环节的各类风险进行监控。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对各类投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款存放在本基金的托管行上海银行，按银行同业利率计息，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易

前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款，结算备付金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2013年 12月31日	1个月 以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产							

银行存款	3,055,469.91	—	—	—	—	—	3,055,469.91
结算备付金	90,456.13	—	—	—	—	—	90,456.13
存出保证金	112,908.18	—	—	—	—	—	112,908.18
交易性金融资产	—	—	—	—	—	58,259,367.05	58,259,367.05
买入返售金融资产	1,500,000.00	—	—	—	—	—	1,500,000.00
应收证券清算款	—	—	—	—	—	141,843.66	141,843.66
应收利息	—	—	—	—	—	962.90	962.90
应收申购款	—	—	—	—	—	2,277.42	2,277.42
资产总计	4,758,834.22	—	—	—	—	58,404,451.03	63,163,285.25
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	99,977.45	99,977.45
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	55,086.24	55,086.24
应付托管费	—	—	—	—	—	8,262.93	8,262.93
应付交易费用	—	—	—	—	—	21,482.02	21,482.02
其他负债	—	—	—	—	—	290,000.00	290,000.00
负债总计	—	—	—	—	—	474,808.64	474,808.64
利率敏感度缺口	4,758,834.22	—	—	—	—	57,929,642.39	62,688,476.61

注：(1) 本基金于2013年03月22日成立，因此无上年度可比期间数据，特此说明；

(2)表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

截至报告期末，本基金无交易性债券投资，因此利率风险因素的对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于证券市场的整体波动，以及单个证券发行主体的自身经营情况或特殊事件影响。

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。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险和跟踪偏离。

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。本基金投资组合中，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%，投资于权证的资产占基金资产净值的0-3%，现金及到期日在一年以内的政府国债的比例不低于基金资产净值的5%。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末2013年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	58,259,367.05	92.93
交易性金融资产-债券投资	—	—
交易性金融资产-贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—

合计	58,259,367.05	92.93
----	---------------	-------

注：本基金于2013年03月22日成立，因此无上年度可比期间数据，特此说明；

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.基金的市场价格风险决定于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及业绩比较基准的变动。	
假设	2.除业绩比较基准变动外，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。	
假设	3.贝塔系数的估计以过去六个月的历史数据作为样本，采用线性回归法估计。	
假设	4.业绩比较基准的变动对基金的净值表现具有对称性影响。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末(2013年12月31日)
	业绩比较基准增加1%	583,110.50
	业绩比较基准减少1%	-583,110.50

注：本基金于2013年03月22日成立，因此无上年度可比期间数据，特此说明；

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本报告期末，本基金无需要说明的其他事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	58,259,367.05	92.24
	其中：股票	58,259,367.05	92.24
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—

4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	1,500,000.00	2.37
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	3,145,926.04	4.98
7	其他各项资产	257,992.16	0.41
8	合计	63,163,285.25	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	3,727,447.95	5.95
C	制造业	24,359,387.04	38.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,967,470.65	3.14
E	建筑业	4,351,782.16	6.94
F	批发和零售业	556,841.40	0.89
G	交通运输、仓储和邮政业	3,444,970.08	5.50
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,022,513.40	1.63
J	金融业	9,973,373.57	15.91
K	房地产业	1,725,347.52	2.75
L	租赁和商务服务业	557,368.24	0.89
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	468,997.14	0.75
	合计	52,155,499.15	83.20

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	157,080.00	0.25
B	采矿业	—	—
C	制造业	3,453,648.00	5.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	298,260.00	0.48
E	建筑业	238,365.00	0.38
F	批发和零售业	369,265.90	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	357,048.00	0.57
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	934,461.00	1.49
L	租赁和商务服务业	142,650.00	0.23
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	153,090.00	0.24
	合计	6,103,867.90	9.74

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 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所有股票投资明细

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	600690	青岛海尔	43,455	847,372.50	1.35
2	600196	复星医药	42,966	841,703.94	1.34
3	601989	中国重工	149,971	841,337.31	1.34
4	002415	海康威视	34,119	784,054.62	1.25
5	000876	新希望	52,608	753,872.64	1.20
6	000039	中集集团	45,033	669,190.38	1.07
7	601992	金隅股份	96,937	659,171.60	1.05
8	600015	华夏银行	75,318	645,475.26	1.03
9	000333	美的集团	12,854	642,700.00	1.03
10	600309	万华化学	30,696	635,407.20	1.01
11	601866	中海集运	256,490	633,530.30	1.01
12	000338	潍柴动力	33,027	627,513.00	1.00
13	000651	格力电器	19,081	623,185.46	0.99
14	601766	中国南车	123,939	620,934.39	0.99
15	000001	平安银行	50,058	613,210.50	0.98
16	600089	特变电工	56,753	608,392.16	0.97
17	600875	东方电气	48,373	608,048.61	0.97
18	601006	大秦铁路	81,437	601,819.43	0.96
19	601018	宁波港	245,686	599,473.84	0.96
20	600600	青岛啤酒	11,992	587,008.40	0.94
21	600000	浦发银行	62,058	585,206.94	0.93
22	600036	招商银行	53,526	582,898.14	0.93
23	600115	东方航空	207,373	574,423.21	0.92
24	002142	宁波银行	61,608	568,641.84	0.91
25	600104	上汽集团	39,955	564,963.70	0.90
26	600415	小商品城	94,952	557,368.24	0.89
27	600058	五矿发展	41,065	556,841.40	0.89

28	000895	双汇发展	11,754	553,378.32	0.88
29	601998	中信银行	142,642	552,024.54	0.88
30	601601	中国太保	29,604	548,562.12	0.88
31	601299	中国北车	111,334	547,763.28	0.87
32	601600	中国铝业	161,088	547,699.20	0.87
33	601618	中国中冶	309,005	540,758.75	0.86
34	601238	广汽集团	65,538	540,033.12	0.86
35	601669	中国电建	175,787	539,666.09	0.86
36	601166	兴业银行	52,936	536,771.04	0.86
37	000157	中联重科	97,471	531,216.95	0.85
38	000709	河北钢铁	264,646	529,292.00	0.84
39	601991	大唐发电	124,130	526,311.20	0.84
40	600029	南方航空	191,172	525,723.00	0.84
41	000528	柳 工	81,254	516,775.44	0.82
42	000776	广发证券	41,098	512,903.04	0.82
43	600050	中国联通	159,431	511,773.51	0.82
44	600406	国电南瑞	34,347	510,739.89	0.81
45	600497	驰宏锌锗	54,482	510,496.34	0.81
46	601111	中国国航	129,114	510,000.30	0.81
47	601288	农业银行	203,995	505,907.60	0.81
48	601800	中国交建	125,001	505,004.04	0.81
49	600383	金地集团	75,331	503,211.08	0.80
50	601009	南京银行	62,123	502,575.07	0.80
51	000539	粤电力 A	105,345	500,388.75	0.80
52	601169	北京银行	66,472	499,204.72	0.80
53	000425	徐工机械	65,550	498,835.50	0.80
54	600019	宝钢股份	121,947	498,763.23	0.80
55	600068	葛洲坝	124,989	494,956.44	0.79
56	000792	盐湖股份	29,500	493,535.00	0.79
57	601328	交通银行	127,886	491,082.24	0.78
58	601668	中国建筑	155,939	489,648.46	0.78

59	601390	中国中铁	182,206	488,312.08	0.78
60	601088	中国神华	30,815	487,493.30	0.78
61	600011	华能国际	96,259	487,070.54	0.78
62	601818	光大银行	182,857	486,399.62	0.78
63	000878	云南铜业	55,410	482,621.10	0.77
64	601699	潞安环能	45,123	481,462.41	0.77
65	600005	武钢股份	217,335	478,137.00	0.76
66	600267	海正药业	32,155	476,537.10	0.76
67	601898	中煤能源	99,668	475,416.36	0.76
68	000562	宏源证券	57,794	475,066.68	0.76
69	601398	工商银行	132,608	474,736.64	0.76
70	000423	东阿阿胶	11,960	473,137.60	0.75
71	601988	中国银行	180,423	472,708.26	0.75
72	601186	中国铁建	100,062	469,290.78	0.75
73	600256	广汇能源	53,661	468,997.14	0.75
74	600096	云天化	52,130	463,957.00	0.74
75	600016	民生银行	60,000	463,200.00	0.74
76	600066	宇通客车	26,207	460,194.92	0.73
77	000807	云铝股份	135,062	459,210.80	0.73
78	600111	包钢稀土	20,616	459,118.32	0.73
79	601939	建设银行	110,338	456,799.32	0.73
80	600900	长江电力	71,788	453,700.16	0.72
81	000937	冀中能源	60,706	450,438.52	0.72
82	601958	金钼股份	62,124	450,399.00	0.72
83	002081	金螳螂	20,324	446,721.52	0.71
84	600362	江西铜业	31,503	446,712.54	0.71
85	600188	兖州煤业	50,029	444,257.52	0.71
86	600160	巨化股份	81,663	438,530.31	0.70
87	000758	中色股份	39,766	427,484.50	0.68
88	600535	天士力	9,902	424,696.78	0.68
89	000002	万科A	52,759	423,654.77	0.68

90	000063	中兴通讯	32,322	422,448.54	0.67
91	000568	泸州老窖	20,520	413,272.80	0.66
92	600048	保利地产	49,775	410,643.75	0.66
93	000869	张裕 A	15,153	409,131.00	0.65
94	002422	科伦药业	8,678	398,233.42	0.64
95	002304	洋河股份	9,743	397,709.26	0.63
96	000858	五粮液	25,317	396,464.22	0.63
97	000024	招商地产	18,664	387,837.92	0.62
98	601117	中国化学	47,178	377,424.00	0.60
99	600519	贵州茅台	2,735	351,119.30	0.56
100	600549	厦门钨业	13,977	336,007.08	0.54

8.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600114	东睦股份	25,100	373,739.00	0.60
2	002327	富安娜	24,900	372,255.00	0.59
3	600575	芜湖港	110,200	357,048.00	0.57
4	000973	佛塑科技	88,000	352,880.00	0.56
5	600604	市北高新	36,400	346,164.00	0.55
6	300057	万顺股份	29,500	340,725.00	0.54
7	002471	中超电缆	33,200	319,052.00	0.51
8	000671	阳光城	32,200	299,138.00	0.48
9	002524	光正集团	30,000	189,600.00	0.30
10	000584	友利控股	19,400	189,538.00	0.30
11	002532	新界泵业	7,100	163,016.00	0.26
12	601339	百隆东方	16,000	162,080.00	0.26
13	600257	大湖股份	21,000	157,080.00	0.25
14	000009	中国宝安	16,200	153,090.00	0.24
15	600738	兰州民百	25,000	151,000.00	0.24

16	000993	闽东电力	22,500	150,750.00	0.24
17	000600	建投能源	33,000	147,510.00	0.24
18	600790	轻纺城	22,500	142,650.00	0.23
19	000725	京东方 A	65,900	141,685.00	0.23
20	600801	华新水泥	11,500	139,610.00	0.22
21	000565	渝三峡 A	18,100	139,370.00	0.22
22	600388	龙净环保	4,100	137,432.00	0.22
23	600449	宁夏建材	17,300	134,767.00	0.21
24	600240	华业地产	32,100	130,326.00	0.21
25	600351	亚宝药业	20,600	128,544.00	0.21
26	000159	国际实业	17,600	127,600.00	0.20
27	600337	美克股份	20,900	125,400.00	0.20
28	000506	中润资源	25,100	114,958.00	0.18
29	600482	风帆股份	9,800	100,352.00	0.16
30	002607	亚夏汽车	12,610	90,665.90	0.14
31	000519	江南红箭	4,300	53,965.00	0.09
32	002310	东方园林	1,500	48,765.00	0.08
33	000029	深深房 A	11,700	43,875.00	0.07
34	601777	力帆股份	5,100	32,691.00	0.05
35	002637	赞宇科技	2,000	31,500.00	0.05
36	600507	方大特钢	4,100	15,047.00	0.02

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600352	浙江龙盛	3,000,267.00	4.79
2	601800	中国交建	2,874,987.60	4.59
3	601117	中国化学	2,767,321.00	4.41
4	000157	中联重科	2,675,430.34	4.27

5	601766	中国南车	2,675,359.56	4.27
6	600066	宇通客车	2,646,007.35	4.22
7	000063	中兴通讯	2,634,354.30	4.20
8	600309	万华化学	2,549,110.19	4.07
9	600196	复星医药	2,483,825.11	3.96
10	000562	宏源证券	2,453,993.00	3.91
11	600600	青岛啤酒	2,451,337.98	3.91
12	600016	民生银行	2,432,163.97	3.88
13	600690	青岛海尔	2,425,029.24	3.87
14	600256	广汇能源	2,415,003.67	3.85
15	600011	华能国际	2,362,976.97	3.77
16	600518	康美药业	2,360,734.02	3.77
17	600050	中国联通	2,339,947.00	3.73
18	600383	金地集团	2,339,824.74	3.73
19	601818	光大银行	2,333,076.00	3.72
20	000527	美的电器	2,316,033.71	3.69
21	600036	招商银行	2,303,619.85	3.67
22	600089	特变电工	2,302,558.88	3.67
23	000100	TCL 集团	2,296,814.82	3.66
24	601006	大秦铁路	2,285,993.00	3.65
25	601166	兴业银行	2,283,594.00	3.64
26	002073	软控股份	2,279,348.35	3.64
27	601939	建设银行	2,267,251.96	3.62
28	600900	长江电力	2,256,016.92	3.60
29	601111	中国国航	2,254,192.70	3.60
30	601018	宁波港	2,245,617.00	3.58
31	000338	潍柴动力	2,245,223.56	3.58
32	600000	浦发银行	2,234,394.23	3.56
33	600497	驰宏锌锗	2,233,638.04	3.56
34	600115	东方航空	2,222,713.20	3.55
35	601988	中国银行	2,214,860.00	3.53

36	601328	交通银行	2,199,493.00	3.51
37	601668	中国建筑	2,198,281.09	3.51
38	000807	云铝股份	2,191,871.65	3.50
39	000002	万科 A	2,188,650.21	3.49
40	601866	中海集运	2,187,895.56	3.49
41	601398	工商银行	2,183,689.88	3.48
42	601618	中国中冶	2,180,071.00	3.48
43	600015	华夏银行	2,178,332.14	3.47
44	601669	中国电建	2,171,533.00	3.46
45	600415	小商品城	2,169,809.99	3.46
46	600019	宝钢股份	2,165,915.00	3.46
47	002422	科伦药业	2,145,826.37	3.42
48	002142	宁波银行	2,144,929.00	3.42
49	601299	中国北车	2,143,668.75	3.42
50	000876	新希望	2,119,887.60	3.38
51	000039	中集集团	2,116,443.30	3.38
52	601009	南京银行	2,114,123.58	3.37
53	601169	北京银行	2,108,030.36	3.36
54	600104	上汽集团	2,106,465.25	3.36
55	000651	格力电器	2,095,135.83	3.34
56	601390	中国中铁	2,093,961.00	3.34
57	600048	保利地产	2,083,218.90	3.32
58	600519	贵州茅台	2,082,613.78	3.32
59	000792	盐湖股份	2,061,064.10	3.29
60	600068	葛洲坝	2,058,867.00	3.28
61	601898	中煤能源	2,051,785.69	3.27
62	600029	南方航空	2,048,078.01	3.27
63	601989	中国重工	2,042,954.00	3.26
64	601998	中信银行	2,039,998.93	3.25
65	600875	东方电气	2,033,295.49	3.24
66	000758	中色股份	2,032,971.57	3.24

67	601601	中国太保	2,028,183.30	3.24
68	601186	中国铁建	2,024,750.31	3.23
69	000423	东阿阿胶	2,017,882.70	3.22
70	600549	厦门钨业	2,014,230.80	3.21
71	600005	武钢股份	2,014,092.05	3.21
72	601088	中国神华	2,012,919.60	3.21
73	600267	海正药业	2,006,346.96	3.20
74	000528	柳 工	2,005,222.93	3.20
75	000858	五 粮 液	2,004,107.02	3.20
76	000709	河北钢铁	2,000,957.73	3.19
77	600362	江西铜业	2,000,455.40	3.19
78	000878	云南铜业	1,997,407.05	3.19
79	000425	徐工机械	1,997,201.50	3.19
80	601992	金隅股份	1,991,007.32	3.18
81	600188	兖州煤业	1,982,293.17	3.16
82	601600	中国铝业	1,955,132.00	3.12
83	601958	金钼股份	1,946,095.68	3.10
84	600111	包钢稀土	1,926,233.12	3.07
85	000937	冀中能源	1,922,839.51	3.07
86	601699	潞安环能	1,919,582.92	3.06
87	600096	云天化	1,916,827.76	3.06
88	000869	张 裕 A	1,914,372.80	3.05
89	000024	招商地产	1,900,952.25	3.03
90	000568	泸州老窖	1,823,961.93	2.91
91	601808	中海油服	1,780,111.51	2.84
92	000825	太钢不锈	1,707,692.00	2.72
93	002304	洋河股份	1,699,025.70	2.71
94	600031	三一重工	1,694,737.94	2.70
95	601318	中国平安	1,614,290.00	2.58
96	600058	五矿发展	1,607,058.51	2.56
97	601001	大同煤业	1,584,123.10	2.53

98	002024	苏宁云商	1,566,387.96	2.50
99	000898	*ST鞍钢	1,553,393.00	2.48
100	600873	梅花集团	1,284,102.59	2.05

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600352	浙江龙盛	3,212,676.88	5.12
2	600518	康美药业	2,624,409.61	4.19
3	002073	软控股份	2,495,067.46	3.98
4	000063	中兴通讯	2,435,549.24	3.89
5	601117	中国化学	2,425,974.88	3.87
6	000527	美的电器	2,305,638.30	3.68
7	600066	宇通客车	2,282,077.41	3.64
8	601766	中国南车	2,273,365.58	3.63
9	601800	中国交建	2,260,461.61	3.61
10	000100	TCL 集团	2,084,637.90	3.33
11	600600	青岛啤酒	2,080,955.27	3.32
12	600196	复星医药	2,016,465.73	3.22
13	600089	特变电工	2,014,753.50	3.21
14	600309	万华化学	1,971,084.97	3.14
15	600383	金地集团	1,859,200.10	2.97
16	000562	宏源证券	1,858,145.96	2.96
17	600016	民生银行	1,857,313.08	2.96
18	600690	青岛海尔	1,851,600.21	2.95
19	000157	中联重科	1,848,875.83	2.95
20	601808	中海油服	1,833,383.45	2.92
21	601818	光大银行	1,776,155.89	2.83
22	600050	中国联通	1,775,719.39	2.83
23	600900	长江电力	1,755,876.27	2.80

24	601939	建设银行	1,755,611.56	2.80
25	600256	广汇能源	1,755,231.69	2.80
26	600011	华能国际	1,729,066.49	2.76
27	601299	中国北车	1,723,893.40	2.75
28	601006	大秦铁路	1,718,234.83	2.74
29	601988	中国银行	1,687,384.10	2.69
30	600036	招商银行	1,684,478.95	2.69
31	600497	驰宏锌锗	1,678,670.72	2.68
32	601668	中国建筑	1,676,144.97	2.67
33	601018	宁波港	1,664,188.36	2.65
34	000651	格力电器	1,662,180.49	2.65
35	601166	兴业银行	1,661,366.30	2.65
36	601398	工商银行	1,652,778.61	2.64
37	600519	贵州茅台	1,630,585.65	2.60
38	000002	万 科 A	1,624,984.06	2.59
39	002024	苏宁云商	1,622,208.26	2.59
40	600000	浦发银行	1,619,798.80	2.58
41	601111	中国国航	1,614,028.27	2.57
42	601866	中海集运	1,610,544.90	2.57
43	601328	交通银行	1,605,934.24	2.56
44	002422	科伦药业	1,600,056.90	2.55
45	000039	中集集团	1,592,757.30	2.54
46	601669	中国电建	1,591,766.89	2.54
47	600549	厦门钨业	1,584,545.40	2.53
48	600015	华夏银行	1,582,503.21	2.52
49	601390	中国中铁	1,582,422.18	2.52
50	000825	太钢不锈	1,582,059.75	2.52
51	600115	东方航空	1,581,061.16	2.52
52	600019	宝钢股份	1,576,230.00	2.51
53	000876	新 希 望	1,572,824.85	2.51
54	600415	小商品城	1,567,181.51	2.50

55	000758	中色股份	1,566,652.30	2.50
56	601009	南京银行	1,555,118.74	2.48
57	601618	中国中冶	1,551,541.73	2.48
58	601169	北京银行	1,550,565.01	2.47
59	000423	东阿阿胶	1,548,720.73	2.47
60	002142	宁波银行	1,545,528.18	2.47
61	600267	海正药业	1,543,442.91	2.46
62	600104	上汽集团	1,541,543.73	2.46
63	600031	三一重工	1,538,680.99	2.45
64	000338	潍柴动力	1,536,561.37	2.45
65	601318	中国平安	1,535,374.18	2.45
66	000807	云铝股份	1,528,915.73	2.44
67	600048	保利地产	1,526,770.26	2.44
68	601186	中国铁建	1,521,934.43	2.43
69	601001	大同煤业	1,521,427.12	2.43
70	601989	中国重工	1,518,035.51	2.42
71	000898	*ST鞍钢	1,502,687.82	2.40
72	000024	招商地产	1,494,960.97	2.38
73	600875	东方电气	1,478,661.97	2.36
74	000858	五 粮 液	1,469,025.18	2.34
75	601601	中国太保	1,467,513.87	2.34
76	600005	武钢股份	1,460,460.42	2.33
77	601998	中信银行	1,444,097.90	2.30
78	600068	葛洲坝	1,441,862.74	2.30
79	601992	金隅股份	1,427,177.92	2.28
80	600111	包钢稀土	1,422,854.01	2.27
81	600362	江西铜业	1,414,896.20	2.26
82	601898	中煤能源	1,411,811.51	2.25
83	600029	南方航空	1,403,539.20	2.24
84	000792	盐湖股份	1,401,938.76	2.24
85	000709	河北钢铁	1,400,072.63	2.23

86	601088	中国神华	1,396,296.56	2.23
87	000869	张裕 A	1,388,257.71	2.21
88	000878	云南铜业	1,371,886.67	2.19
89	000528	柳工	1,366,940.99	2.18
90	000425	徐工机械	1,361,527.82	2.17
91	601958	金钼股份	1,357,142.77	2.16
92	601600	中国铝业	1,354,481.43	2.16
93	000568	泸州老窖	1,334,917.19	2.13
94	600096	云天化	1,333,504.19	2.13
95	600873	梅花集团	1,329,333.85	2.12
96	600188	兖州煤业	1,312,040.80	2.09
97	000937	冀中能源	1,289,209.36	2.06
98	601699	潞安环能	1,287,822.93	2.05

8.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	244,957,250.65
卖出股票的收入（成交）总额	184,191,951.82

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	112,908.18
2	应收证券清算款	141,843.66

3	应收股利	—
4	应收利息	962.90
5	应收申购款	2,277.42
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	257,992.16

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资部分前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 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部分前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
745	89,017.32	—	—	66,317,901.24	100.00 %

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	—	—
------------------	---	---

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。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

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	—
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,275,069.23
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	183,352,962.86
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	66,317,901.24

注：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。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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、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于2013年3月22日正式成立，关家雄先生任该基金的基金经理；

2、基金管理人2013年4月12日公告，聘请刘未先生为基金管理人总经理，原总经理陈东升先生因个人原因离任；

3、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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)。报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为五万元，目前该事务所已为本基金提供审计服务的年限为2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

11.7 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		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	427,695,201.26	100.00%	—	—	2,939,900,000.00	100.00%	—	—	300,397.39	100.00%	

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于财通基金增加中国农业银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-02-23
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增加中国工商银行股份有限公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-02-27
3	关于财通基金增加深圳众禄基金销售有限公司为代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-03-08
4	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生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-03-23
5	财通基金管理有限公司高级管理	中国证监会指定报刊及网	2013-04-12

	人员变更公告	站	
6	财通基金管理有限公司关于与易宝支付合作开通网上直销业务并参与网上直销申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-04-17
7	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开放日常申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-04-20
8	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在代销机构推出定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-04-23
9	财通基金管理有限公司关于设立上海财通资产管理有限公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-06-05
10	财通基金管理有限公司关于与支付宝合作开通网上直销业务并参与网上直销申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-07-01
11	财通基金管理有限公司关于旗下基金2013年半年度资产净值的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-07-01
12	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	中国证监会指定报刊及网站	2013-07-10
13	财通基金管理有限公司关于再次提醒投资者警惕不法人员及机构假冒本公司名义实施非法证券行为的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-07-13
14	中证财通中国可持续发展 100(ECPI ESG)指数增强型证券	中国证监会指定报刊及网站	2013-07-18

	投资基金2013年第2季度报告		
15	关于财通基金增加和讯信息科技有限公司为代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-07-31
16	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2013年半年度报告及其摘要	中国证监会指定报刊及网站	2013-08-29
17	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2013年第3季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2013-10-23
18	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(2013年第1号)及其摘要	中国证监会指定报刊及网站	2013-11-02
19	财通基金管理有限公司关于"野风资管借道财通基金淘金定增募资先行引发违规质疑"的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-11-27
20	财通基金管理有限公司关于外国人、港澳台居民投资本公司旗下基金开立证券投资基金账户的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-12-12
21	财通基金管理有限公司关于通过淘宝平台开展基金销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-12-18
22	财通基金管理有限公司关于调整旗下基金网上直销单笔认申购最低金额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2013-12-18
23	四川路桥建设股份有限公司简式权益变动报告书	中国证监会指定报刊及网站	2013-12-21

§12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：<http://www.ctfund.com>

财通基金管理有限公司
二〇一四年三月二十九日