

**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2016年第3季度报告**

**2016年09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**

**报告送出日期：2016年10月24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2016年10月21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。

本报告期自2016年7月1日起至9月30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	34,787,121.85份
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。
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

### §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（2016年07月01日-2016年09月30日）
1.本期已实现收益	711,266.08
2.本期利润	674,217.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.0267
4.期末基金资产净值	48,119,044.71
5.期末基金份额净值	1.383

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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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	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	①-③	②-④

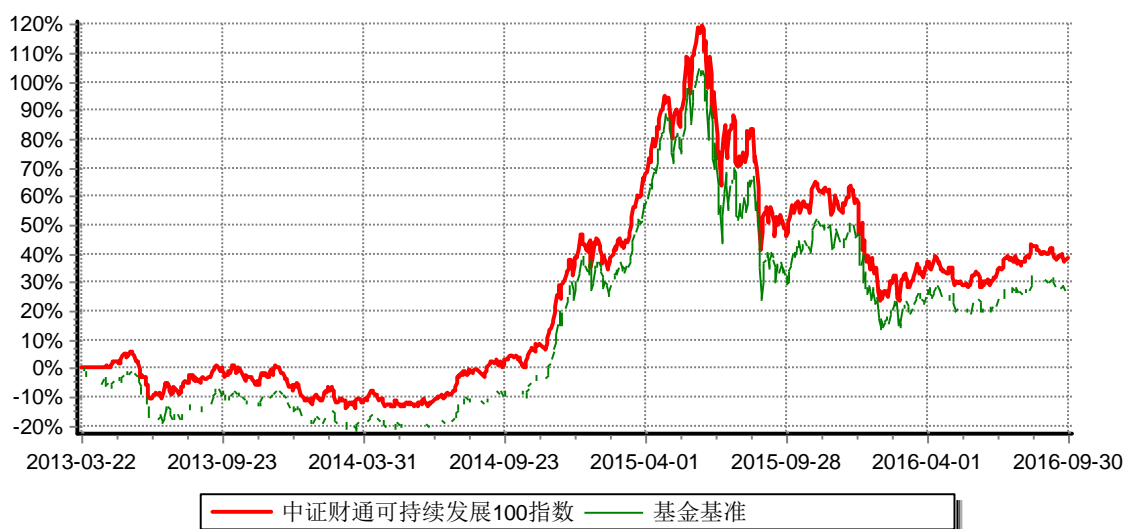
				④		
过去三个月	5.09%	0.78%	4.72%	0.79%	0.37%	-0.01%

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  
 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-2016年09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：≥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%。由于股票市场波动，本基金在9月30日股票投资占资产净值比例为95.1168%，被动违反了基金合同中关于“本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的95%”的规定，本基金已于10月10日调整至基金合同规定范围内。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，除上述情况外，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04月21日	—	5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。

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"离任日期"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》、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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，工业增加值增速较二季度有所提升，PPI降幅逐步收窄，工业企业利润上升。固定资产投资增速继续下行，制造业、房地产、基建几个分项均有所下滑，但房地产销售依然火爆，30个大中城市商品房成交面积连续三个月走强。美联储9月加息再次落空，国内十年国债收益率跌破年初低点后低位震荡。市场在“英国脱欧”大跌后逐步企稳，三季度实现小幅上涨。

报告期内，本基金根据多因子模型和事件驱动策略进行了积极配置，相对业绩比较基准获得了一定的超额收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2016年3季度，本基金净值增长率为5.09%，业绩比较基准增长率为4.72%，跑赢业绩比较基准0.37%。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。

#### 4.6 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人的情况出现；本基金资产净值于2016年6月1日至2016年8月22日期间连续57个工作日低于5000万元，并于2016年8月23日恢复至5000万元以上。本基金管理人将持续关注本基金资产净值情况，并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作。

#### 4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，政府或仍将托底经济，通过积极的财政政策和大力推进PPP项目等措施对冲固定资产投资下滑，房地产调控的影响或不会立即显现，工业生产有望维持平稳运行。美国四季度加息概率较大，人民币汇率继续面临考验。一二线城市房价高企，房地产市场进入新一轮调控周期。货币政策宽松空间受到上述因素制约，无风险利率下行幅度有限。证券保证金余额显示增量资金匮乏，投资者风险偏好依然较低。预计市场大幅上行和下行的空间均将受限。

我们将坚持价值投资，立足可持续发展，并通过指数增强，为持有人实现良好的投资回报。

### §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	45,769,305.43	94.22
	其中：股票	45,769,305.43	94.22
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	2,736,544.22	5.63
8	其他资产	72,112.01	0.15
9	合计	48,577,961.66	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

#### 5.2.1.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

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	1,873,699.00	3.89
C	制造业	14,890,304.52	30.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,402,703.00	4.99
E	建筑业	3,278,395.25	6.81
F	批发和零售业	868,333.00	1.80
G	交通运输、仓储和邮政业	2,316,009.28	4.81
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,901,119.00	3.95
J	金融业	8,276,724.35	17.20
K	房地产业	1,324,880.00	2.75
L	租赁和商务服务业	1,744,274.00	3.62
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	780,244.00	1.62



	合计	39,656,685.40	82.41
--	----	---------------	-------

### 5.2.1.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

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	365,435.36	0.76
C	制造业	3,773,126.82	7.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	332,902.40	0.69
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	464,528.00	0.97
G	交通运输、仓储和邮政业	231,539.00	0.48
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	590,702.00	1.23
J	金融业	—	—
K	房地产业	354,386.45	0.74
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	6,112,620.03	12.70

### 5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通机制投资的港股。

## 5.3 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

### 5.3.1 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	300058	蓝色光标	84,900	915,222.00	1.90
2	600188	兖州煤业	69,100	860,295.00	1.79
3	600415	小商品城	102,100	829,052.00	1.72
4	000333	美的集团	30,300	818,403.00	1.70
5	000002	万 科 A	31,200	816,504.00	1.70
6	000338	潍柴动力	88,100	811,401.00	1.69
7	601006	大秦铁路	127,892	810,835.28	1.69
8	002153	石基信息	33,100	808,302.00	1.68
9	000783	长江证券	75,900	806,058.00	1.68
10	600741	华域汽车	51,000	803,250.00	1.67

### 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

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	600759	洲际油气	16,500	131,835.00	0.27
2	002503	搜于特	9,056	123,342.72	0.26
3	002164	宁波东力	12,400	122,264.00	0.25
4	300324	旋极信息	5,600	121,520.00	0.25
5	600743	华远地产	24,200	121,242.00	0.25

### 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。

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	50,710.37
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	738.17
5	应收申购款	309.63
6	其他应收款	—
7	待摊费用	20,353.84
8	其他	—
9	合计	72,112.01

#### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 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

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	600759	洲际油气	131,835.00	0.27	重大资产重组

#### 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

报告期期初基金份额总额	17,730,773.59
报告期期间基金总申购份额	19,651,529.29
减：报告期期间基金总赎回份额	2,595,181.03
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	—

报告期期末基金份额总额	34,787,121.85
-------------	---------------

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。

## §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

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	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,828,670.63
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	5.26

### 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	0.40%
合计			1,828,670.63	3,000,000.00	

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，公司根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定，在《中国证券报》、《证券时报》及管理人网站进行了如下信息披露：

1、2016年7月1日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下基金2016年半年度资产净值的公告》；

2、2016年7月20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2016年第2季度报告》；

3、2016年7月20日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告》；

4、2016年7月20日披露了《财通基金管理有限公司关于上市公司认购旗下资产管理计划的公告》；

5、2016年7月22日披露了《基金销售网点及销售人员资格信息一览表》；

6、2016年8月5日披露了《天津天海投资发展股份有限公司简式权益变动报告书》；

7、2016年8月10日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下基金增加代销机构并参

加基金申购费率优惠活动的公告》；

8、2016年8月12日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告》；

9、2016年8月12日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下基金增加代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告》；

10、2016年8月12日披露了《关于财通基金管理有限公司增加第一创业证券股份有限公司为代销机构并参加基金费率优惠活动的公告》；

11、2016年8月26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2016年半年度报告》及其摘要；

12、2016年8月30日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下资产管理计划投资锦州新华龙铝业股份有限公司股份情况的公告》；

13、2016年9月12日披露了《深圳市证通电子股份有限公司简式权益变动报告书》；

14、2016年9月14日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告》；

15、2016年9月14日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下基金增加代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告》；

16、2016年9月20日披露了《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行基金申购费率优惠活动的公告》；

17、2016年9月22日披露了《财通基金管理有限公司高级管理人员变更公告》；

18、2016年9月28日披露了《上海龙宇燃油股份有限公司简式权益变动报告书》。

19、2016年9月30日披露了《关于财通基金管理有限公司旗下部分基金增加代销机构的公告》。

20、本报告期内，公司按照《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  
二〇一六年十月二十四日