

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 2021 年中期报告

2021 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:2021 年 08 月 28 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本中期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2021年8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及其更新。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年6月30日止。

## 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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
7.7 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	63
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	63
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	63

7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12	投资组合报告附注	63
§8	基金份额持有人信息	65
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	66
§9	开放式基金份额变动	67
§10	重大事件揭示	67
10.1	基金份额持有人大会决议	67
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	67
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4	基金投资策略的改变	68
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	68
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	68
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
10.8	其他重大事件	69
§11	影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	73
§12	备查文件目录	73
12.1	备查文件目录	73
12.2	存放地点	73
12.3	查阅方式	73

## §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	
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	104,016,256.69份	
基金合同存续期	不定期	
上市日期	2013-03-22	
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	104,016,256.69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；

(3) 本基金自2021年8月19日起本基金的基金简称由“中证财通可持续发展100指数”变更为“财通中证ESG100指数增强”，A类基金份额简称由“中证财通可持续发展100指数A”变更为“财通中证ESG100指数增强A”，C类基金份额简称由“中证财通可持续发展100指数C”变更为“财通中证ESG100指数增强C”，基金代码和其他信息均保持不变。

### 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
------	---

	<p>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。</p>	
业绩比较基准	<p>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%。</p>	
风险收益特征	<p>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。</p>	
下属分级基金的风险收益特征	<p>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。</p>	<p>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。</p>

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	周直毅
	联系电话	021-20537888	021-68475608
	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
注册地址		上海市虹口区吴淞路619号505室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号

办公地址	上海市银城中路68号时代金融中心41/43楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号37层、42层
邮政编码	200120	200120
法定代表人	夏理芬	金煜

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ctfund.com">http://www.ctfund.com</a>
基金中期报告备置地点	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
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41/43楼

## §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(2021年01月01日-2021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	39,935,599.48	-
本期利润	19,647,390.56	-
加权平均基金份额本期利润	0.1788	-
本期加权平均净值利润率	9.13%	-
本期基金份额净值增长	8.34%	-

率		
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2021年06月30日)	
期末可供分配利润	106,051,688.68	-
期末可供分配基金份额利润	1.0196	-
期末基金资产净值	210,067,945.37	-
期末基金份额净值	2.0196	1.0000
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	178.45%	-

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于2017年4月14日成立，截至报告期末，本基金C类份额份数为0，C类份额初始净值为1.0000元；

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中证财通可持续发展100指数A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.34%	0.74%	-2.56%	0.63%	2.22%	0.11%
过去三个月	4.96%	0.81%	-0.15%	0.71%	5.11%	0.10%
过去六个月	8.34%	1.15%	1.10%	1.02%	7.24%	0.13%
过去一年	47.17%	1.21%	25.36%	1.16%	21.81%	0.05%
过去三年	76.44%	1.24%	32.07%	1.24%	44.37%	0.00%
自基金合同生效起至今	178.45%	1.30%	91.72%	1.38%	86.73%	-0.08%



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%	-2.56%	0.63%	2.56%	-0.63%
过去三个月	0.00%	0.00%	-0.15%	0.71%	0.15%	-0.71%
过去六个月	0.00%	0.00%	1.10%	1.02%	-1.10%	-1.02%
过去一年	0.00%	0.00%	25.36%	1.16%	-25.3 6%	-1.16%
过去三年	0.00%	0.00%	32.07%	1.24%	-32.0 7%	-1.24%
自基金合同 生效起至今	0.00%	0.00%	28.78%	1.14%	-28.7 8%	-1.14%

注：(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

(2)本基金的业绩比较基准为：中证财通中国可持续发展 100（ECPI ESG）指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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

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

### 3.2.2 自基金转型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



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173人，管理人员和主要业务骨干的证券、基金从业平均年限在7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		
朱海东	本基金的基金经理、量化投资一部总监助理（主持工作）	2019-07-16	-	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理，负责产品投资管理以及量化模型开发工作。2019年6月加入财通基金管理有限公司，现任量化投资一部总监助理（主持工作）、基金经理。
吴迪	原基金经理	2016-04-21	2021-05-26	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，先后担任战略产品部产品经理、量化投资部研究员、基金经理助理、量化投资一部基金经理。
--	--	--	--	--	---

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》、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，此外积极参与新股申购，进一步增强组合相对于业绩基准的阿尔法。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中证财通可持续发展100指数A基金份额净值为2.0196元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为8.34%，同期业绩比较基准收益率为1.10%；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1.10%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前，PPI与CPI剪刀差位于历史极值附近，经济存在一定的压力，而国内货币环境相对宽松，在这样的宏观背景下，我们看好成长风格继续优秀表现。同时，我们判断消

费板块参与性价比越来越高，值得关注。对于周期板块，我们认为其性价比正在逐步下降。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

基金管理人与中国工商银行股份有限公司上海市分行于2018年6月签订了《基金行政外包协议》，与中信中证投资服务有限责任公司于2019年7月签订了《行政管理服务协议》，与申万宏源证券有限公司于2019年9月签订了《运营服务合同》、于2020年5月签订了《基金运营服务合同》。截至报告期末，基金管理人对旗下部分特定客户资产管理计划估值业务实行外包。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

报告期内，本基金未有连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情况出现。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金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 托管人对本中期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 中期财务会计报告(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：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	11,509,839.34	14,070,051.16
结算备付金		582,606.50	518,972.35
存出保证金		119,806.29	139,600.42
交易性金融资产	6.4.7.2	198,491,049.77	252,362,807.37
其中：股票投资		198,479,340.97	252,362,807.37

基金投资		-	-
债券投资		11,708.80	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		402,188.61	460,887.80
应收利息	6.4.7.5	2,511.84	3,511.28
应收股利		-	-
应收申购款		35,142.86	13,257.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		211,143,145.21	267,569,088.37
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		211,095.00	37,033.03
应付管理人报酬		170,178.81	217,391.37
应付托管费		25,526.84	32,608.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	178,358.44	227,709.24
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-



其他负债	6.4.7.8	490,040.75	490,132.16
负债合计		1,075,199.84	1,004,874.51
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	104,016,256.69	142,997,264.05
未分配利润	6.4.7.10	106,051,688.68	123,566,949.81
所有者权益合计		210,067,945.37	266,564,213.86
负债和所有者权益总计		211,143,145.21	267,569,088.37

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额净值2.0196元，基金份额总额104,016,256.69份，其中A类基金份额净值2.0196元，份额总额104,016,256.69份；C类基金份额净值1.0000元，份额总额0.00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：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
<b>一、收入</b>		22,011,017.60	1,609,482.14
1.利息收入		48,310.47	74,005.08
其中：存款利息收入	6.4.7.11	48,307.49	74,005.08
债券利息收入		2.98	-
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）		42,183,019.09	20,767,411.22
其中：股票投资收益	6.4.7.12	40,697,670.19	19,520,098.65
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-

资产支持证券投资 收益	6.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	1,485,348.90	1,247,312.57
3.公允价值变动收益(损失 以“-”号填列)	6.4.7.18	-20,288,208.92	-19,714,224.33
4.汇兑收益(损失以“-” 号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号 填列)	6.4.7.19	67,896.96	482,290.17
<b>减：二、费用</b>		2,363,627.04	3,613,768.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,065,250.92	1,236,939.73
2. 托管费	6.4.10.2.2	159,787.61	185,540.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	949,158.36	1,994,167.30
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	6.4.7.21	189,430.15	197,120.32
<b>三、利润总额(亏损总额 以“-”号填列)</b>		19,647,390.56	-2,004,286.20
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-” 号填列)</b>		19,647,390.56	-2,004,286.20

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：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021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)	142,997,264.05	123,566,949.81	266,564,213.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,647,390.56	19,647,390.56
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)	-38,981,007.36	-37,162,651.69	-76,143,659.05
其中：1.基金申购款	10,035,069.51	9,735,323.54	19,770,393.05
2.基金赎回款	-49,016,076.87	-46,897,975.23	-95,914,052.10
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)	104,016,256.69	106,051,688.68	210,067,945.37
项目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020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)	399,708,446.28	148,114,289.37	547,822,735.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,004,286.20	-2,004,286.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	-275,538,337.82	-99,882,474.42	-375,420,812.24

“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	7,450,618.98	2,407,109.28	9,857,728.26
2.基金赎回款	-282,988,956.80	-102,289,583.70	-385,278,540.50
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）	124,170,108.46	46,227,528.75	170,397,637.21

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

刘为臻

刘为臻

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中证财通中国可持续发展100（ECPI ESG）指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]100号《关于核准中证财通中国可持续发展100（ECPI ESG）指数增强型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人财通基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2013年3月22日正式生效，首次设立募集规模为247,395,794.87份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为财通基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券、银行存款、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。其中，投资于中证财通中国可持续发展100（ECPI ESG）指数成份股和备选成份股的资产不低于基金资产的80%；投资于权证的资产不超过基金资产净值的3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规

或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：中证财通中国可持续发展100（ECPI ESG）指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》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2021年06月30日的财务状况以及2021年上半年度的经营成果和净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## 2. 增值税

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

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

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

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

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

## 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

## 4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	11,509,839.34
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	11,509,839.34

注：本基金本报告期末未投资于定期存款。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		191,820,891.79	198,479,340.97	6,658,449.18
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	8,000.00	11,708.80	3,708.80
	银行间市场	-	-	-
	合计	8,000.00	11,708.80	3,708.80
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		191,828,891.79	198,491,049.77	6,662,157.98

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产或负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	2,192.86



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	262.10
应收债券利息	2.98
应收资产支持证券利息	-
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	53.90
合计	2,511.84

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	178,358.44
银行间市场应付交易费用	-
合计	178,358.44

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	780.60
预提费用	489,260.15
合计	490,040.75

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 中证财通可持续发展100指数A

金额单位：人民币元

项目 (中证财通可持续发展100指数A)	本期2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	142,997,264.05	142,997,264.05
本期申购	10,035,069.51	10,035,069.51
本期赎回（以“-”号填列）	-49,016,076.87	-49,016,076.87
本期末	104,016,256.69	104,016,256.69

#### 6.4.7.9.2 中证财通可持续发展100指数C

金额单位：人民币元

项目 (中证财通可持续发展100指数C)	本期2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	-	-

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。报告期内C类基金份额未有申购数据。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 中证财通可持续发展100指数A

单位：人民币元

项目 (中证财通可持续发展100指数A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	149,567,984.83	-26,001,035.02	123,566,949.81
本期利润	39,935,599.48	-20,288,208.92	19,647,390.56
本期基金份额交易产生的变动数	-46,414,249.78	9,251,598.09	-37,162,651.69
其中：基金申购款	12,553,960.50	-2,818,636.96	9,735,323.54

基金赎回款	-58,968,210.28	12,070,235.05	-46,897,975.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	143,089,334.53	-37,037,645.85	106,051,688.68

#### 6.4.7.10.2 中证财通可持续发展100指数C

单位：人民币元

项目 (中证财通可持续发展 100指数C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-	-	-
本期基金份额交易产 生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-	-	-

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。报告期内C类基金份额未有申购数据。

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	43,163.98
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	4,052.84
其他	1,090.67
合计	48,307.49

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	383,032,197.41
减：卖出股票成本总额	342,334,527.22
买卖股票差价收入	40,697,670.19

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期未有基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期未投资债券，债券投资收益为零。

##### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期未有债券买卖差价收入。

##### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未有债券赎回差价收入。

##### 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未有债券申购差价收入。

##### 6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未投资资产支持证券，资产支持证券收益为零。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.15.2 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益--赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益--申购差价收入。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,485,348.90
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,485,348.90

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1.交易性金融资产	-20,288,208.92
——股票投资	-20,291,917.72
——债券投资	3,708.80
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-

合计	-20,288,208.92
----	----------------

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	67,846.47
转换费收入	50.49
合计	67,896.96

注：A类份额赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产。对持有期长于7日的基金份额所收取的赎回费，不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费；C类份额赎回费用将全额计入基金财产。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	949,158.36
银行间市场交易费用	-
合计	949,158.36

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	170.00
指数使用费	100,000.00
合计	189,430.15

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至2021年06月30日止，本基金未发生需要披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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。

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,065,250.92	1,236,939.73
其中：支付销售机构的客户维护费	80,390.28	49,859.07

注：(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值1.00%的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付；

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

(3)客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	159,787.61	185,540.99

注：(1)支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付；

(2)基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

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

### 6.4.10.3 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。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

中证财通可持续发展100指数A



份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	1,828,670.63
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	1,828,670.63
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	1.47%

中证财通可持续发展100指数C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注：(1)总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额；

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

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

#### 6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 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	本期	上年度可比期间

称	2021年01月01日至2021年06月30日		2020年01月01日至2020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	11,509,839.34	43,163.98	10,013,612.55	59,060.02

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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 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。

##### 6.4.10.7.2 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其他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。

#### 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
000157	中联重科	2021-02-08	2021-08-10	认购非公开发行证券	10.17	9.03	196,657	2,000,001.69	1,775,812.71	-
600810	神马股份	2021-03-26	2021-09-24	认购非公开发	7.31	11.41	109,439	799,999.09	1,248,698.99	-

				行证 券						
0009 51	中国 重汽	2021- 03-12	2021- 09-15	认购 非公 开发 行证 券	29.82	26.27	16,768	500,0 21.76	440,4 95.36	-
6886 80	海优 新材	2021- 01-15	2021- 07-22	新股 限售	69.94	243.6 1	1,256	87,84 4.64	305,9 74.16	-
6881 31	皓元 医药	2021- 06-01	2021- 12-08	新股 限售	64.99	247.1 0	978	63,56 0.22	241,6 63.80	-
6886 09	九联 科技	2021- 03-15	2021- 09-23	新股 限售	3.99	15.29	10,372	41,38 4.28	158,5 87.88	-
6886 26	翔宇 医疗	2021- 03-23	2021- 10-08	新股 限售	28.82	104.1 6	1,383	39,85 8.06	144,0 53.28	-
6883 15	诺禾 致源	2021- 04-02	2021- 10-13	新股 限售	12.76	39.20	3,265	41,66 1.40	127,9 88.00	-
6880 79	美迪 凯	2021- 02-23	2021- 09-02	新股 限售	10.19	18.40	6,196	63,13 7.24	114,0 06.40	-
6882 16	气派 科技	2021- 06-15	2021- 12-23	新股 限售	14.82	47.64	2,000	29,64 0.00	95,28 0.00	-
6886 39	华恒 生物	2021- 04-14	2021- 10-22	新股 限售	23.16	42.28	2,074	48,03 3.84	87,68 8.72	-
6886 07	康众 医疗	2021- 01-25	2021- 08-02	新股 限售	23.21	44.50	1,890	43,86 6.90	84,10 5.00	-
3010 18	申菱 环境	2021- 06-28	2021- 07-07	认购 新发 证券	8.29	8.29	7,029	58,27 0.41	58,27 0.41	-
3010 18	申菱 环境	2021- 06-28	2022- 01-07	新股 限售	8.29	8.29	782	6,48 2.78	6,48 2.78	-
3010 17	漱玉 平民	2021- 06-23	2021- 07-05	认购 新发 证券	8.86	8.86	4,995	44,25 5.70	44,25 5.70	-

301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股限售	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	认购新发证券	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	认购新发证券	21.96	21.96	1,999	43,898.04	43,898.04	-
688092	爱科科技	2021-03-12	2021-09-22	新股限售	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股限售	47.33	251.96	136	6,436.88	34,266.56	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	认购新发证券	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股限售	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股限售	28.77	99.85	202	5,811.54	20,169.70	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股限售	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	认购新发证券	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股限售	21.31	49.94	326	6,947.06	16,280.44	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股限售	12.54	27.89	557	6,984.78	15,534.73	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股限售	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
3009	南极	2021-	2021-	新股	12.76	43.38	307	3,91	13,31	-

40	光	01-27	08-03	限售				7.32	7.66	
3006 14	百川 畅银	2021- 05-18	2021- 11-25	新股 限售	9.19	40.38	329	3,02 3.51	13,28 5.02	-
3009 37	药易 购	2021- 01-20	2021- 07-27	新股 限售	12.25	53.71	244	2,98 9.00	13,10 5.24	-
3010 13	利和 兴	2021- 06-21	2021- 12-29	新股 限售	8.72	27.11	471	4,10 7.12	12,76 8.81	-
3009 42	易瑞 生物	2021- 02-02	2021- 08-09	新股 限售	5.31	28.52	443	2,35 2.33	12,63 4.36	-
3010 02	崧盛 股份	2021- 05-27	2021- 12-07	新股 限售	18.71	57.62	201	3,76 0.71	11,58 1.62	-
3009 55	嘉亨 家化	2021- 03-16	2021- 09-24	新股 限售	16.53	46.07	232	3,83 4.96	10,68 8.24	-
3009 96	普联 软件	2021- 05-26	2021- 12-03	新股 限售	20.81	42.23	241	5,01 5.21	10,17 7.43	-
3009 56	英力 股份	2021- 03-16	2021- 09-27	新股 限售	12.85	25.80	371	4,76 7.35	9,57 1.80	-
3009 62	中金 辐照	2021- 03-29	2021- 10-11	新股 限售	3.40	16.37	576	1,95 8.40	9,42 9.12	-
3009 68	格林 精密	2021- 04-06	2021- 10-15	新股 限售	6.87	12.07	774	5,31 7.38	9,34 2.18	-
3009 52	恒辉 安防	2021- 03-03	2021- 09-13	新股 限售	11.72	27.08	340	3,98 4.80	9,20 7.20	-
3010 16	雷尔 伟	2021- 06-23	2021- 12-30	新股 限售	13.75	32.98	275	3,78 1.25	9,06 9.50	-
3009 66	共同 药业	2021- 03-31	2021- 10-11	新股 限售	8.24	31.54	286	2,35 6.64	9,02 0.44	-
3009 45	曼卡 龙	2021- 02-03	2021- 08-10	新股 限售	4.56	18.88	474	2,16 1.44	8,94 9.12	-
3009 48	冠中 生态	2021- 02-18	2021- 08-25	新股 限售	13.00	27.42	216	2,80 8.00	5,92 2.72	-
3009 48	冠中 生态	2021- 06-04	2021- 08-25	新股 限售-	-	27.42	108	-	2,96 1.36	-

				转增						
300931	通用 电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股 限售	4.31	13.11	672	2,89 6.32	8,80 9.92	-
300961	深水 海纳	2021-03-23	2021-09-30	新股 限售	8.48	22.07	394	3,34 1.12	8,69 5.58	-
300981	中红 医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股 限售	48.59	90.39	95	4,61 6.05	8,58 7.05	-
300950	德固 特	2021-02-24	2021-09-03	新股 限售	8.41	39.13	219	1,84 1.79	8,56 9.47	-
300958	建工 修复	2021-03-18	2021-09-29	新股 限售	8.53	27.22	300	2,55 9.00	8,16 6.00	-
300926	博俊 科技	2020-12-29	2021-07-07	新股 限售	10.76	22.20	359	3,86 2.84	7,96 9.80	-
300993	玉马 遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股 限售	12.10	19.29	410	4,96 1.00	7,90 8.90	-
300930	屹通 新材	2021-01-13	2021-07-21	新股 限售	13.11	24.48	322	4,22 1.42	7,88 2.56	-
300971	博亚 精工	2021-04-07	2021-10-15	新股 限售	18.24	28.29	245	4,46 8.80	6,93 1.05	-
301004	嘉益 股份	2021-06-18	2021-12-27	新股 限售	7.81	21.94	312	2,43 6.72	6,84 5.28	-
300991	创益 通	2021-05-12	2021-11-22	新股 限售	13.06	26.51	254	3,31 7.24	6,73 3.54	-
300927	江天 化学	2020-12-29	2021-07-07	新股 限售	13.39	30.10	217	2,90 5.63	6,53 1.70	-
300986	志特 新材	2021-04-21	2021-11-01	新股 限售	14.79	30.57	211	3,12 0.69	6,45 0.27	-
300975	商络 电子	2021-04-14	2021-10-21	新股 限售	5.48	13.03	492	2,69 6.16	6,41 0.76	-
300963	中洲 特材	2021-03-30	2021-10-11	新股 限售	12.13	22.49	283	3,43 2.79	6,36 4.67	-
301011	华立 科技	2021-06-09	2021-12-17	新股 限售	14.20	33.84	175	2,48 5.00	5,92 2.00	-

300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股限售	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	新股限售	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	新股限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-20	新股限售	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股限售	24.90	24.81	192	4,780.80	4,763.52	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股限售	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

#### 6.4.12.2 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁	2021-06	重大	5.59	2021-07	6.15	385,449	3,086,051.15	2,154,659.91	-

	易 购	-16	事 项		-06					
--	--------	-----	--------	--	-----	--	--	--	--	--

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 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。

#### 6.4.12.3.2 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估，建立相应的分级别的交易对手库，并分别限定交易额度，同时采取一定的风险缓释措施。本基金的银行存款存放在本基金的托管人上海银行股份有限公司，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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手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。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

##### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

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，并对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不超过7个工作日可变现资产的可变现价值，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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2021年06月30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	11,509,839.34	-	-	-	-	-	11,509,839.34
结算备付金	582,606.50	-	-	-	-	-	582,606.50
存出保证金	119,806.29	-	-	-	-	-	119,806.29
交易性金融资产	-	-	-	-	11,708.80	198,479,340.97	198,491,049.77
应收证券	-	-	-	-	-	402,188.61	402,188.61

清算款							
应收利息	-	-	-	-	-	2,511.84	2,511.84
应收申购款	-	-	-	-	-	35,142.86	35,142.86
资产总计	12,212,252.13	-	-	-	11,708.80	198,919,184.28	211,143,145.21
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	211,095.00	211,095.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	170,178.81	170,178.81
应付托管费	-	-	-	-	-	25,526.84	25,526.84
应付交易费用	-	-	-	-	-	178,358.44	178,358.44
其他负债	-	-	-	-	-	490,040.75	490,040.75
负债总计	-	-	-	-	-	1,075,199.84	1,075,199.84
利率敏感度缺口	12,212,252.13	-	-	-	11,708.80	197,843,984.44	210,067,945.37
上年度末 2020 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	14,070,051.16	-	-	-	-	-	14,070,051.16

存款							
结算 备付 金	518,972.35	-	-	-	-	-	518,972.35
存出 保证 金	139,600.42	-	-	-	-	-	139,600.42
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	252,362,807.3 7	252,362,807.3 7
应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-	460,887.80	460,887.80
应收 利息	-	-	-	-	-	3,511.28	3,511.28
应收 申购 款	-	-	-	-	-	13,257.99	13,257.99
资产 总计	14,728,623.9 3	-	-	-	-	252,840,464.4 4	267,569,088.3 7
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	37,033.03	37,033.03
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	217,391.37	217,391.37
应付 托管 费	-	-	-	-	-	32,608.71	32,608.71
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	227,709.24	227,709.24
其他 负债	-	-	-	-	-	490,132.16	490,132.16
负债 总计	-	-	-	-	-	1,004,874.51	1,004,874.51

利率 敏感 度缺 口	14,728,623.9 3	-	-	-	-	251,835,589.9 3	266,564,213.8 6
---------------------	-------------------	---	---	---	---	--------------------	--------------------

注：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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末均未持有交易性固定收益类投资（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
----	--------------------	---------------------

	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	198,479,340.97	94.48	252,362,807.37	94.67
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	11,708.80	0.01	-	-
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	198,491,049.77	94.49	252,362,807.37	94.67

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.基金的市场价格风险取决于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及行业比较基准的变动。		
	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。		
	3.贝塔系数的估计以过去一年的历史数据作为样本，采用线性回归法估计。		
	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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准增加1%	2,130,241.12	2,620,664.15
	业绩比较基准减少1%	-2,130,241.12	-2,620,664.15

#### 6.4.14 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2021年06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192,919,663.62元，属于第二层次的余额为人民币228,709.31元，属于第三层次的余额为人民币5,342,676.84元（于2020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246,291,618.17元，属于第二层次的余额为人民币149,784.86元，属于第三层次的余额为人民币5,921,404.34元）。

(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变动情况如下：

单位：人民币元

	交易性金融资产
上年度末	5,921,404.34
转入第三层次	-
转出第三层次	2,453,518.36
当期计入损益的利得或损失总额	437,884.57
购买	3,964,015.17
出售	2,527,108.88
本期末	5,342,676.84
本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动	1,371,893.20

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	198,479,340.97	94.00
	其中：股票	198,479,340.97	94.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,708.80	0.01
	其中：债券	11,708.80	0.01
	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	12,092,445.84	5.73
8	其他各项资产	559,649.60	0.27
9	合计	211,143,145.21	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,000,807.80	0.48
C	制造业	93,613,667.42	44.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,395,403.76	3.52
E	建筑业	7,059,590.04	3.36
F	批发和零售业	5,634,149.73	2.68
G	交通运输、仓储和邮政业	9,633,972.13	4.59
H	住宿和餐饮业	-	-



I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,850,991.32	3.74
J	金融业	27,239,857.64	12.97
K	房地产业	5,623,619.44	2.68
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	3,629,491.32	1.73
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	168,681,550.60	80.30

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	751,348.04	0.36
B	采矿业	827,516.00	0.39
C	制造业	19,612,565.99	9.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	114,425.00	0.05
E	建筑业	366,298.28	0.17
F	批发和零售业	1,539,091.58	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	535,373.68	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	489,896.27	0.23
J	金融业	4,040,778.30	1.92
K	房地产业	318,257.90	0.15
L	租赁和商务服务业	151,290.00	0.07

M	科学研究和技术服务业	538,769.00	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	306,680.33	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	205,500.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	29,797,790.37	14.18

### 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	002142	宁波银行	131,999	5,144,001.03	2.45
2	000858	五粮液	13,114	3,906,529.46	1.86
3	000725	京东方 A	617,500	3,853,200.00	1.83
4	002230	科大讯飞	57,009	3,852,668.22	1.83
5	300015	爱尔眼科	51,134	3,629,491.32	1.73
6	600900	长江电力	173,848	3,588,222.72	1.71
7	601166	兴业银行	174,200	3,579,810.00	1.70
8	002415	海康威视	54,700	3,528,150.00	1.68
9	601919	中远海控	113,900	3,478,506.00	1.66
10	000100	TCL科技	425,000	3,251,250.00	1.55
11	000001	平安银行	142,600	3,225,612.00	1.54
12	600309	万华化学	29,243	3,182,223.26	1.51
13	600690	海尔智家	122,327	3,169,492.57	1.51
14	600104	上汽集团	137,999	3,031,838.03	1.44
15	600332	白云山	86,619	2,932,053.15	1.40

16	600741	华域汽车	110,071	2,891,565.17	1.38
17	600196	复星医药	36,500	2,632,745.00	1.25
18	000338	潍柴动力	140,500	2,510,735.00	1.20
19	002422	科伦药业	124,729	2,488,343.55	1.18
20	002304	洋河股份	12,000	2,486,400.00	1.18
21	002241	歌尔股份	57,600	2,461,824.00	1.17
22	000157	中联重科	266,191	2,418,306.87	1.15
23	000333	美的集团	33,410	2,384,471.70	1.14
24	600837	海通证券	203,800	2,343,700.00	1.12
25	600031	三一重工	79,938	2,323,797.66	1.11
26	000625	长安汽车	87,645	2,303,310.60	1.10
27	002146	荣盛发展	399,700	2,254,308.00	1.07
28	600655	豫园股份	193,698	2,244,959.82	1.07
29	600271	航天信息	171,200	2,230,736.00	1.06
30	601633	长城汽车	50,500	2,201,295.00	1.05
31	002024	苏宁易购	385,449	2,154,659.91	1.03
32	601009	南京银行	203,209	2,137,758.68	1.02
33	000776	广发证券	138,040	2,089,925.60	0.99
34	601377	兴业证券	216,300	2,089,458.00	0.99
35	600660	福耀玻璃	36,894	2,060,529.90	0.98
36	600886	国投电力	209,964	2,017,754.04	0.96
37	600019	宝钢股份	263,200	2,010,848.00	0.96
38	000425	徐工机械	310,908	1,980,483.96	0.94
39	000568	泸州老窖	8,300	1,958,302.00	0.93
40	000651	格力电器	35,845	1,867,524.50	0.89
41	002001	新和成	64,715	1,856,026.20	0.88
42	002202	金风科技	149,000	1,811,840.00	0.86
43	601231	环旭电子	107,600	1,808,756.00	0.86
44	600111	北方稀土	84,600	1,751,220.00	0.83
45	601186	中国铁建	232,700	1,728,961.00	0.82
46	002008	大族激光	42,500	1,716,575.00	0.82

47	601668	中国建筑	367,956	1,710,995.40	0.81
48	002007	华兰生物	45,490	1,668,573.20	0.79
49	600600	青岛啤酒	14,400	1,665,360.00	0.79
50	600183	生益科技	67,492	1,579,987.72	0.75
51	000069	华侨城 A	206,353	1,535,266.32	0.73
52	601877	正泰电器	44,993	1,501,866.34	0.71
53	600018	上港集团	288,500	1,376,145.00	0.66
54	601600	中国铝业	257,244	1,363,393.20	0.65
55	601390	中国中铁	260,140	1,363,133.60	0.65
56	600795	国电电力	527,300	1,281,339.00	0.61
57	601933	永辉超市	261,000	1,234,530.00	0.59
58	600893	航发动力	23,100	1,228,689.00	0.58
59	600115	中国东航	230,600	1,171,448.00	0.56
60	601336	新华保险	25,499	1,170,659.09	0.56
61	600519	贵州茅台	558	1,147,638.60	0.55
62	601111	中国国航	143,967	1,120,063.26	0.53
63	002236	大华股份	52,651	1,110,936.10	0.53
64	600050	中国联通	253,400	1,094,688.00	0.52
65	002153	石基信息	46,450	1,092,039.50	0.52
66	601788	光大证券	59,900	1,071,611.00	0.51
67	002493	荣盛石化	59,653	1,030,207.31	0.49
68	000895	双汇发展	31,813	1,011,653.40	0.48
69	603993	洛阳钼业	193,955	1,000,807.80	0.48
70	601006	大秦铁路	148,800	979,104.00	0.47
71	600161	天坛生物	28,569	978,488.25	0.47
72	600177	雅戈尔	148,432	978,166.88	0.47
73	600383	金地集团	91,863	940,677.12	0.45
74	002410	广联达	13,358	911,015.60	0.43
75	000783	长江证券	124,400	910,608.00	0.43
76	601555	东吴证券	108,400	904,056.00	0.43
77	600066	宇通客车	71,613	894,446.37	0.43

78	600048	保利地产	74,200	893,368.00	0.43
79	600999	招商证券	45,912	873,246.24	0.42
80	600109	国金证券	68,800	873,072.00	0.42
81	601618	中国中冶	290,130	864,587.40	0.41
82	600004	白云机场	75,852	848,025.36	0.40
83	600588	用友网络	25,400	844,804.00	0.40
84	601989	中国重工	202,100	832,652.00	0.40
85	601688	华泰证券	52,300	826,340.00	0.39
86	600498	烽火通信	41,700	776,871.00	0.37
87	000876	新希望	52,441	769,309.47	0.37
88	601669	中国电建	195,072	754,928.64	0.36
89	600009	上海机场	13,727	660,680.51	0.31
90	601800	中国交建	98,300	636,984.00	0.30
91	600011	华能国际	120,400	508,088.00	0.24
92	601766	中国中车	10,700	65,056.00	0.03
93	600406	国电南瑞	2,400	55,776.00	0.03

### 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	600036	招商银行	45,500	2,465,645.00	1.17
2	600810	神马股份	109,439	1,248,698.99	0.59
3	300677	英科医疗	8,200	1,023,360.00	0.49
4	601838	成都银行	70,000	884,800.00	0.42
5	002840	华统股份	87,900	791,979.00	0.38
6	002714	牧原股份	12,168	740,057.76	0.35
7	600710	苏美达	109,100	674,238.00	0.32
8	000727	冠捷科技	238,300	629,112.00	0.30
9	000807	云铝股份	49,900	593,810.00	0.28

10	600089	特变电工	46,100	592,385.00	0.28
11	002382	蓝帆医疗	25,800	537,930.00	0.26
12	603886	元祖股份	30,700	535,101.00	0.25
13	300124	汇川技术	6,101	453,060.26	0.22
14	000951	中国重汽	16,768	440,495.36	0.21
15	688111	金山办公	1,100	434,280.00	0.21
16	600887	伊利股份	10,200	375,666.00	0.18
17	601088	中国神华	18,900	368,928.00	0.18
18	600153	建发股份	44,900	363,690.00	0.17
19	688356	键凯科技	1,100	361,350.00	0.17
20	600029	南方航空	59,900	360,598.00	0.17
21	688016	心脉医疗	700	318,227.00	0.15
22	688680	海优新材	1,256	305,974.16	0.15
23	300458	全志科技	3,400	298,044.00	0.14
24	002430	杭氧股份	8,200	283,638.00	0.14
25	603195	公牛集团	1,400	282,800.00	0.13
26	600702	舍得酒业	1,300	277,914.00	0.13
27	603678	火炬电子	4,100	276,750.00	0.13
28	000915	华特达因	10,300	275,319.00	0.13
29	603486	科沃斯	1,200	273,696.00	0.13
30	300223	北京君正	2,700	272,484.00	0.13
31	603035	常熟汽饰	16,700	272,210.00	0.13
32	002106	莱宝高科	23,500	264,375.00	0.13
33	002833	弘亚数控	6,800	263,500.00	0.13
34	600475	华光环能	25,710	262,242.00	0.12
35	000977	浪潮信息	9,300	261,609.00	0.12
36	002179	中航光电	3,300	260,766.00	0.12
37	000550	江铃汽车	11,100	260,073.00	0.12
38	603489	八方股份	1,100	260,018.00	0.12
39	300394	天孚通信	9,960	252,187.20	0.12
40	002705	新宝股份	9,600	252,000.00	0.12

41	600096	云天化	17,900	251,316.00	0.12
42	000716	黑芝麻	74,700	247,257.00	0.12
43	688131	皓元医药	978	241,663.80	0.12
44	601699	潞安环能	19,000	224,390.00	0.11
45	600436	片仔癀	500	224,150.00	0.11
46	300750	宁德时代	400	213,920.00	0.10
47	002758	浙农股份	21,900	207,174.00	0.10
48	601318	中国平安	3,200	205,696.00	0.10
49	600763	通策医疗	500	205,500.00	0.10
50	688608	恒玄科技	597	189,195.27	0.09
51	002713	东易日盛	27,000	188,190.00	0.09
52	002495	佳隆股份	80,800	187,456.00	0.09
53	601012	隆基股份	2,100	186,564.00	0.09
54	600184	光电股份	16,700	181,529.00	0.09
55	002594	比亚迪	713	178,963.00	0.09
56	300982	苏文电能	3,170	173,982.28	0.08
57	300059	东方财富	5,280	173,131.20	0.08
58	603259	药明康德	1,080	169,117.20	0.08
59	300014	亿纬锂能	1,561	162,234.73	0.08
60	603501	韦尔股份	500	161,000.00	0.08
61	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.08
62	002271	东方雨虹	2,650	146,598.00	0.07
63	002475	立讯精密	3,149	144,854.00	0.07
64	688626	翔宇医疗	1,383	144,053.28	0.07
65	300760	迈瑞医疗	300	144,015.00	0.07
66	603899	晨光文具	1,700	143,752.00	0.07
67	000059	华锦股份	17,500	142,800.00	0.07
68	688323	瑞华泰	4,513	142,565.67	0.07
69	603288	海天味业	1,049	135,268.55	0.06
70	002352	顺丰控股	1,956	132,421.20	0.06
71	300122	智飞生物	700	130,711.00	0.06

72	688981	中芯国际	2,100	129,822.00	0.06
73	688315	诺禾致源	3,265	127,988.00	0.06
74	300999	金龙鱼	1,500	127,440.00	0.06
75	000701	厦门信达	21,200	121,052.00	0.06
76	600028	中国石化	27,600	120,336.00	0.06
77	601100	恒立液压	1,400	120,288.00	0.06
78	601888	中国中免	400	120,040.00	0.06
79	601138	工业富联	9,500	117,895.00	0.06
80	600742	一汽富维	11,500	117,185.00	0.06
81	600282	南钢股份	32,900	117,124.00	0.06
82	000581	威孚高科	5,600	116,648.00	0.06
83	000661	长春高新	300	116,100.00	0.06
84	000528	柳工	14,100	115,620.00	0.06
85	600606	绿地控股	21,200	115,540.00	0.06
86	688314	康拓医疗	1,085	114,619.40	0.05
87	688079	美迪凯	6,196	114,006.40	0.05
88	600803	新奥股份	6,900	113,919.00	0.05
89	600707	彩虹股份	12,100	113,861.00	0.05
90	601857	中国石油	21,300	112,677.00	0.05
91	601628	中国人寿	3,300	111,837.00	0.05
92	600817	宏盛科技	8,200	111,438.00	0.05
93	600276	恒瑞医药	1,578	107,256.66	0.05
94	000002	万科 A	4,500	107,145.00	0.05
95	300981	中红医疗	944	104,405.19	0.05
96	601077	渝农商行	24,600	98,154.00	0.05
97	688216	气派科技	2,000	95,280.00	0.05
98	600800	渤海化学	21,900	94,827.00	0.05
99	600585	海螺水泥	2,300	94,415.00	0.04
100	688639	华恒生物	2,074	87,688.72	0.04
101	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.04
102	300986	志特新材	2,105	82,721.65	0.04



103	600835	上海机电	4,500	73,125.00	0.03
104	000656	金科股份	11,900	68,901.00	0.03
105	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.03
106	300985	致远新能	1,914	54,512.10	0.03
107	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.02
108	601658	邮储银行	9,700	48,694.00	0.02
109	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
110	688087	英科再生	1,999	43,898.04	0.02
111	300894	火星人	628	42,704.00	0.02
112	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.02
113	688633	星球石墨	672	37,544.64	0.02
114	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
115	300957	贝泰妮	136	34,266.56	0.02
116	600057	厦门象屿	5,000	31,250.00	0.01
117	002732	燕塘乳业	1,300	30,329.00	0.01
118	000683	远兴能源	6,300	29,421.00	0.01
119	600704	物产中大	3,700	29,119.00	0.01
120	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
121	600297	广汇汽车	8,000	23,040.00	0.01
122	001965	招商公路	2,900	20,938.00	0.01
123	601598	中国外运	4,100	20,705.00	0.01
124	300953	震裕科技	202	20,169.70	0.01
125	688068	热景生物	98	18,522.00	0.01
126	688665	四方光电	133	18,107.95	0.01
127	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
128	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
129	000961	中南建设	2,800	16,576.00	0.01
130	300941	创识科技	331	16,537.44	0.01
131	300925	法本信息	600	15,774.00	0.01
132	301009	可靠股份	557	15,534.73	0.01
133	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01

134	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
135	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
136	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
137	301013	利和兴	471	12,768.81	0.01
138	300942	易瑞生物	446	12,723.49	0.01
139	688598	金博股份	47	12,643.00	0.01
140	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
141	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.01
142	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.01
143	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.01
144	300956	英力股份	407	10,548.12	0.01
145	000626	远大控股	600	10,368.00	0.00
146	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
147	300917	特发服务	365	10,095.90	0.00
148	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
149	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
150	300968	格林精密	774	9,342.18	0.00
151	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
152	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
153	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
154	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
155	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
156	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
157	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
158	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
159	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
160	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
161	688093	世华科技	200	7,952.00	0.00
162	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
163	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
164	600755	厦门国贸	900	7,389.00	0.00

165	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
166	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
167	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
168	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
169	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
170	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
171	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
172	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
173	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
174	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
175	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
176	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
177	600060	海信视像	300	5,070.00	0.00
178	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
179	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
180	000034	神州数码	200	4,370.00	0.00
181	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
182	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
183	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
184	002139	拓邦股份	200	3,598.00	0.00
185	601211	国泰君安	200	3,428.00	0.00
186	601881	中国银河	300	3,234.00	0.00
187	600998	九州通	200	3,074.00	0.00
188	600958	东方证券	300	2,997.00	0.00
189	603156	养元饮品	100	2,858.00	0.00
190	603949	雪龙集团	200	2,836.00	0.00
191	600352	浙江龙盛	200	2,748.00	0.00
192	601117	中国化学	300	2,628.00	0.00
193	000703	恒逸石化	200	2,390.00	0.00
194	300740	水羊股份	100	2,088.00	0.00
195	601988	中国银行	600	1,848.00	0.00

196	600068	葛洲坝	200	1,498.00	0.00
197	002958	青农商行	300	1,284.00	0.00
198	300322	硕贝德	100	1,253.00	0.00
199	601225	陕西煤业	100	1,185.00	0.00
200	601398	工商银行	200	1,034.00	0.00
201	300229	拓尔思	100	897.00	0.00
202	601577	长沙银行	100	894.00	0.00
203	600705	中航产融	200	774.00	0.00
204	000627	天茂集团	200	724.00	0.00
205	601872	招商轮船	154	711.48	0.00
206	601939	建设银行	100	665.00	0.00
207	601128	常熟银行	100	620.00	0.00
208	600390	五矿资本	100	598.00	0.00
209	601985	中国核电	100	506.00	0.00

## 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	600519	贵州茅台	6,797,084.00	2.55
2	000001	平安银行	6,327,531.60	2.37
3	600036	招商银行	6,252,981.00	2.35
4	000338	潍柴动力	6,220,877.00	2.33
5	000858	五粮液	6,062,507.00	2.27
6	601166	兴业银行	5,949,401.00	2.23
7	300015	爱尔眼科	5,268,833.06	1.98
8	000568	泸州老窖	4,459,291.00	1.67
9	002001	新和成	3,999,461.90	1.50
10	002142	宁波银行	3,933,620.00	1.48
11	002146	荣盛发展	3,626,782.00	1.36

12	000157	中联重科	3,475,471.73	1.30
13	000425	徐工机械	3,444,902.92	1.29
14	600893	航发动力	3,288,693.32	1.23
15	002714	牧原股份	3,284,700.00	1.23
16	600900	长江电力	3,246,706.00	1.22
17	600690	海尔智家	3,224,507.23	1.21
18	600309	万华化学	3,137,975.00	1.18
19	002202	金风科技	3,117,866.69	1.17
20	601933	永辉超市	3,047,469.00	1.14

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	600519	贵州茅台	12,885,514.00	4.83
2	601166	兴业银行	9,572,156.00	3.59
3	601633	长城汽车	8,572,558.00	3.22
4	000858	五粮液	8,251,199.31	3.10
5	000001	平安银行	8,034,503.24	3.01
6	601919	中远海控	6,863,380.97	2.57
7	002142	宁波银行	6,502,289.00	2.44
8	000338	潍柴动力	5,203,814.27	1.95
9	600036	招商银行	5,072,429.00	1.90
10	600309	万华化学	4,655,458.00	1.75
11	600089	特变电工	4,640,789.28	1.74
12	000157	中联重科	4,310,698.99	1.62
13	600690	海尔智家	3,789,621.02	1.42
14	002493	荣盛石化	3,765,555.44	1.41
15	603993	洛阳钼业	3,581,672.00	1.34
16	000333	美的集团	3,520,955.00	1.32

17	600019	宝钢股份	3,511,760.08	1.32
18	600104	上汽集团	3,477,523.00	1.30
19	600031	三一重工	3,465,636.50	1.30
20	600027	华电国际	3,347,545.46	1.26

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	308,742,978.54
卖出股票收入（成交）总额	383,032,197.41

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	11,708.80	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,708.80	0.01

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123111	东财转3	80	11,708.80	0.01

### 7.7 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。

### 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。

### 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宁波银行（证券代码：002142.SZ）代理销售保险不规范，收到中国银行保险监督管理委员会宁波监管局罚款人民币25万元；授信业务未履行关系人回避制度、贷后管理不到位，收到中国银行保险监督管理委员会宁波监管局罚款人民币30万元。报告期内，本基金投资的前十名证券的兴业银行（证券代码：

601166.SH) 因1.为无证机构提供转接清算服务,且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定; 2.为支付机构超范围(超业务、超地域)经营提供支付服务,且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性; 3.违规连通上、下游支付机构,提供转接清算服务,且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性; 4.违反银行卡收单外包管理规定; 5.未按规定履行客户身份识别义务,收到中国人民银行福州中心支行罚款1,382.44万元; 因同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保,收到中国银行保险监督管理委员会福建监管局罚款人民币960万元。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。

**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	119,806.29
2	应收证券清算款	402,188.61
3	应收股利	-



4	应收利息	2,511.84
5	应收申购款	35,142.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	559,649.60

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	600810	神马股份	1,248,698.99	0.59	非公开发行锁定

#### 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	持有份额	占总份

	户数 (户)			份额 比例		额比例
中证 财通 可持 续发 展100 指数A	3,506	29,668.07	83,520,632.33	80.30%	20,495,624.36	19.70%
中证 财通 可持 续发 展100 指数C	0.00	0.00	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	3,506	29,668.07	83,520,632.33	80.30%	20,495,624.36	19.70%

### 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	56,299.05	0.0541%
	中证财通可持续发展100指数C	-	-
	合计	56,299.05	0.0541%

### 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 研究部门负责人持有本开放式 基金	中证财通可持续发展100指数A	0
	中证财通可持续发展100指数C	0

	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中证财通可持续发展100指数A	0
	中证财通可持续发展100指数C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	中证财通可持续发展100指数A	中证财通可持续发展100指数C
基金合同生效日(2013年03月22日)基金份额总额	247,395,794.87	-
本报告期期初基金份额总额	142,997,264.05	-
本报告期基金总申购份额	10,035,069.51	-
减：本报告期基金总赎回份额	49,016,076.87	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	104,016,256.69	-

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、基金管理人于2021年8月6日聘任吴林惠先生担任公司第四届董事会董事职务，原董事夏理芬先生于2021年8月6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

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	438,796,655.35	64.21%	316,804.37	64.18%	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	7,190,479.74	1.05%	5,196.54	1.05%	-
华泰	2	-	-	-	-	-

证券						
联讯 证券	2	-	-	-	-	-
西藏 东方 财富 证券	2	237,401,876.13	34.74%	171,584.51	34.76%	-

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。

## 10.8 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	《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》	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
2	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司基金费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-26
3	《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》	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-10
4	《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》	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-16
5	《中证财通中国可持续发展	中国证监会指定报刊	2021-03-27

	100(ECPI ESG)指数增强型证券投资基金2020年年度报告》	及网站	
6	《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》	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-30
7	《财通基金管理有限公司关于旗下部分公募基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第3号-指数基金指引〉修订基金合同部分条款的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-31
8	《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（2021年3月31日）》	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-31
9	《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（2021年3月31日）》	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-31
10	《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（2021年3月31日公告）》	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-31
11	《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（2021年3月31日）》	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-31
12	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海国金理益财富基金销售有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
13	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加宁波银行股份有限公司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	2021-04-10

14	《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2021年第一季度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-21
15	《财通基金管理有限公司关于旗下投资组合调整停牌股票估值方法的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12
16	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加光大证券股份有限公司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	2021-05-14
17	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国中金财富证券有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-25
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 (2021年5月27日公告) 》	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-27
19	《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 (2021年5月27日公告) 》	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-27
20	《中证财通中国可持续发展100 (ECPI ESG) 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-27
21	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券股份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	2021-06-18
22	《财通基金管理有限公司关于根据<公开募集证券投资基金侧袋机制指引 (试行)>修订旗下部分公募基金基金合同的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-26
23	《中证财通中国可持续发展100	中国证监会指定报刊	2021-06-26

	(ECPI ESG) 指数增强型证券投资基金更新招募说明书(2021年6月26日公告)》	及网站	
24	《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(2021年6月26日公告)》	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-26
25	《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(2021年6月26日公告)》	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-26

### §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	2020-04-27 至 2021-06-30	32,668,409.02	0.00	0.00	32,668,409.02	31.41%
机构	2	2020-04-27 至 2021-06-30	32,226,232.68	0.00	0.00	32,226,232.68	30.98%
机构	3	2020-01-21 至 2021-01-28	39,537,390.72	0.00	39,537,390.72	0.00	0.00%
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。本基金的投资范围包括存托凭证，面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险、与存托凭证发行机制相关的风险等。</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>							



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

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## §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  
二〇二一年八月二十八日