华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)

2014 第二季度报告

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月15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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	华宝油气
基金主代码	162411
交易代码	162411
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2011年9月29日
报告期末基金份额总额	45,026,084.01份
投资目标	通过严格的指数化投资策略,实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪,力争控制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5%(以美元资产计价)。
投资策略	本基金原则上采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况(如股票停牌、流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将使用其他合理方法进行适当的替代,追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金还可能将一定比例的基金资产投资于与标的指数相关的公募基金、上市交易型基金,以优化投资组合的建立,达到节约交易成本和有效追踪标的指数表现的目的。
业绩比较基准	标普石油天然气上游股票指数(全收益指数)
风险收益特征	本基金是一只美国股票指数型证券投资基金,风险与预期收益高于混合型基金、债券基金以及货币市场基金,属于预期风险较高的产品。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	-	纽约梅隆银行
注册地址		-	One Wall Street New York,NY10286
办公地址		-	One Wall Street New York,NY10286
邮政编码		-	NY10286

§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(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	311,392.13
2.本期利润	3,697,944.28
3.加权平均基金份额本期利润	0.1300
4.期末基金资产净值	59,462,492.83
5.期末基金份额净值	1.321

注:1.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。

2.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。

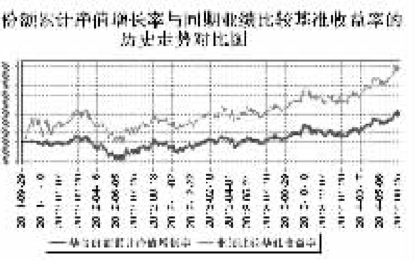
3.2 基金净值表现

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④	①-③	②-④
过去三个月	12.43%	1.03%	14.90%	1.11%	-2.47%	-0.08%

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

(2011年9月29日至2014年6月30日)



注:1、按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2012年3月29日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§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		
施施乐	本基金基金经理	2013年6月18日	-	11年	硕士。曾在法国兴业银行上海分行担任项目融资部门和信贷部客户经理;2003年加入华宝兴业基金管理有限公司,先后担任内控审计及风险管理部总经理、渠道业务发展部总经理、基金经理助理、投资经理和高级分析师。2013年6月起任华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金经理。

注:1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化,标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)在短期内出现过持有的现金与到期日在一年之内的政府债券市值占基金资产净值比低于5%的情况;由于成分股调整,该基金在短期内出现过持有不属于标普石油天然气上游股票指数成分股及其备选成分股的情况。发生此类情况后,该基金均在合理期限内得到了调整,没有给投资人带来额外风险或损失。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制,确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求,分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差;分析结果未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,基金管理人未发生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%。本报告期内,本基金未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金采用全复制方法跟踪标普石油天然气上游股票指数,为投资者提供分享行业板块收益工具。以下为对影响标的指数表现的市场因素分析。

股市大环境方面,2014年二季度美国标普500指数整体继续保持2009年初以来的上涨趋势,累计上涨4.7%,仅在二季度初的几天回落过3%。关于QE退出和加息的讨论从未停止。但核心国家债券收益率尚未出现上行,标普500期权隐含波动率指数(VIX)则创下新低。受长期资金半年多以来大量配置能源类资产的影响,二季度油气股票指数表现继续大幅超越其它行业,但波动也比较剧烈。以美元计价的2014年2季度油气指数整体涨幅近15%,年化日均波幅也是15%,约为标普500指数的两倍。

二季度多数时间内国际油价比较稳定,进入6月后略有提升。布伦特从108美元的平均水平提高到113美元;而在出口概念拉动下,美国原油期货一季度与布伦特价差收窄后,二季度从100美元同步提升到105美元,但多少仍保持了相对的价格优势。以北海天然气为代表的国际天然气价格在二季度继续回落,从等值8.5美元/百万英热继续回落到7美元以下,符合国际上认为天然气2014年价格会因远东需求下滑而保持走弱的预期;但是,美国Henry Hub天然气价格却一直保持在4.5美元/百万英热上下,处于2012年以来的相对高位,但仍远优于国际价格而彰显了美国经济的能源优势。能源价格的整体稳定偏弱有利于复苏中的发达国家经济;而美国在继续保持能源价格优势同时开始有机会出口能源又令本国能源生产企业盈利情况看好。几方面综合因素都有利于美国上市油气开发行业的股票表现。

人民币汇率方面,2014年二季度人民币实际交易汇率在6.20至6.26上下1%的幅度内持续震荡,而同期的人行中间价(指导价)则在6.16附近以自己的节奏波动,两者价差在1-2%之间。双重汇率价格和极不相称的波幅导致较大的申赎损失和以人民币计算的跟踪误差拉大。由于持续申购,本季度基金规模新增1.5倍,而由于基金美元资产法定按指导价进行估值,直接导致基金业绩落后指数近2.5%;而整个2014年二季度,以人民币计算的业绩与标的指数的年化跟踪误差测算大幅增加至接近1.7%。

受上述几项综合影响,本基金2014年2季度人民币净值增长12.43%,落后同期基金基准指数上涨的14.90%,业绩差异主要来自于申赎现金流受人民币估值价差影响及基金的相关费用。

由于板块指数波动引发的交易情绪,基金在2季度有较大的申赎流量,造成仓位波动和较大的外汇交易成本。6月下旬指数成分调整也对现金流产生一定影响。目前基金已完成成分调整,运作平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,报告期内基金份额净值增长率为12.43%,同期业绩比较基准收益率为14.90%,基金表现较基准有一定落后。

以上差异主要来自于汇率、法规要求、合同基准设置、交易清算规则和费用,跟踪误差主要来自人民银行名义汇率、申赎引起的交易成本的影响。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

受发达国家经济弱复苏、中国调整经济增长方式和能源结构、各地区地缘政治博弈、季节压力较小等等综合影响,传统能源总体无论在价格还是供应量上都还比较稳定。能源不是普通商品,它关乎相互博弈的经济体的未来,是牵一发动全身的经济要素。但它是战略性的长期资源配属,不可夸大短期、局部价格波动的影响。另一方面,在更有效率的储能方法革命到来前传统能源产业也不会有逻辑性改变,无外乎关注相关大宗商品的物流。后期可继续注意欧美亚天然气供需变化,及相关生产开发企业储量的估值。

目前的环境被理解为有利于尤其是国际性纯商业油气开发企业的规划生产、提高效率和盈利预期。标的指数近几年也一直保持在一个大型上升通道中。但需要注意其作为周期性行业指数,业绩波动约为标普500综指的两倍。影响市场短期价格的因素非常多,我们仍建议一般投资者关注长期的基本面和自身综合资产配置。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	54,276,426.18	81.01
	其中:普通股	54,276,426.18	81.01
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,586,177.00	15.80
8	其他资产	2,133,689.74	3.18
9	合计	66,996,292.92	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	54,276,426.18	91.28
合计	54,276,426.18	91.28

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	54,276,426.18	91.28
材料	-	-
工业	-	-
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
保健	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
合计	54,276,426.18	91.28

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资。

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

5.4.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	ABRAXAS PETROLEUM CORP	Abraxas石油有限公司	AXAS US	纳斯达克	美国	20,046	772,102.32	1.30
2	GASTAR EXPLO-RATION INC	Gastar勘探股份有限公司	GST US	纽约	美国	14,251	763,723.74	1.28
3	RSP PERMIAN INC	RSP Permian Inc	RSPP US	纽约	美国	3,600	718,548.60	1.21
4	EMERALD OIL INC	翡翠石油股份有限公司	EOX US	纽约	美国	15,064	709,046.21	1.19
5	CALLON PETROLEUM CO	Callon 石油公司	CPE US	纽约	美国	9,776	700,744.85	1.18
6	HALCON RESOURCES CORP	Halcon资源公司	HK US	纽约	美国	15,517	695,998.15	1.17
7	PENN VIRGINIA CORP	Penn Virginia公司	PVA US	纽约	美国	6,665	695,092.58	1.17
8	NEWFIELD EXPLO-RATION CO	新田石油勘探公司	NFX US	纽约	美国	2,547	692,666.23	1.16
9	SWIFT ENERGY CO	斯威夫特能源公司	SFY US	纽约	美国	8,593	686,265.71	1.15
10	CARRIZO OIL & GAS INC	Carrizo油气股份有限公司	CRZO US	纳斯达克	美国	1,608	685,237.83	1.15

5.4.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末金融衍生品余额为零.

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序需特别说明。

5.10.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	4,675.14
4	应收利息	309.29
5	应收申购款	2,098,458.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.08
8	其他	-
9	合计	2,133,689.74

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告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。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	21,499,664.69
报告期期间基金总申购份额	34,693,218.51
减:报告期期间基金总赎回份额	11,166,799.19
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	45,026,084.01

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;
华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)基金合同;
华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)招募说明书;
华宝兴业标普石油天然气上游股票指数证券投资基金(LOF)托管协议;
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告;
基金托管人业务资格批件和营业执照。

8.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

8.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站,查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
2014年7月18日

华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金

2014 第二季度报告

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月15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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	华宝兴业成熟市场QDII
基金主代码	241002
交易代码	241002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年3月15日
报告期末基金份额总额	25,300,203.94份
投资目标	本基金通过投资于发达市场交易型开放式基金(ETF)等金融工具,在国际范围内分散投资风险,追求基金资产长期增值。
投资策略	本基金的投资策略主要分为资产配置策略和单个金融产品选择策略两个部分,其中,将基金资产在全球成熟金融市场的股票类资产和债券类资产之间进行配置将是本基金获取超额收益的主要来源。
业绩比较基准	50%MSCI 全球指数(此处指全收益指数)+50%花旗全球政府债券指数。
风险收益特征	本基金的风险收益特征类似于全球平衡型基金,属于中等预期风险和收益的证券投资品种,其预期风险和收益水平低于全球股票型基金,高于债券基金和货币市场基金。
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Lyxor Asset Management S.A.	Bank of China(Hong Kong)
	中文	领先资产管理公司	中国银行(香港)有限公司
注册地址		17 cours Valmy,Tours Societe Generale,92800 Puteaux,France	香港花园道1 号中银大厦
办公地址		17 cours Valmy,Tours Societe Generale,92800 Puteaux,France	香港花园道1 号中银大厦

§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(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	623,527.54
2.本期利润	706,608.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0259
4.期末基金资产净值	26,395,801.13
5.期末基金份额净值	1.043

注:1、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。

2、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。

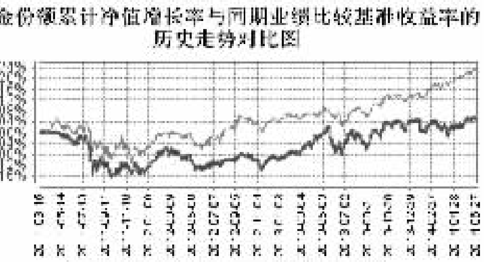
3.2 基金净值表现

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④	①-③	②-④
过去三个月	2.56%	0.44%	3.59%	0.22%	-1.03%	0.22%

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

(2011年3月15日至2014年6月30日)



注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2011年9月15日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

§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		
周晶	策略部总经理、本基金基金经理,华宝兴业资产管理(香港)有限公司策略研究部经理	2013年6月18日	-	8年	博士。先后在美国德州奥斯丁市德亚资本、泛太平洋证券(美国)和汇丰证券(美国)从事数量分析、另类投资分析和证券投资研究工作。2005年至2007年在华宝兴业基金管理有限公司任内控审计风险管理部主管,2011年再次加入华宝兴业基金管理有限公司任策略部总经理兼首席策略分析师。2013年6月起兼任华宝兴业成熟市场QDII基金经理。目前兼任华宝兴业资产管理(香港)有限公司策略研究部经理。

注:1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Guillaume Lasserre	领先资产量化多资产组合管理部(Systematic Multi assets portfolio management)总经理兼机构方案部(Dedicated Solutions)联席负责人	11	Guillaume Lasserre先生于2009年10月加入领先资产的量化多资产团队,担任组合经理一职。2004年,Lasserre先生的职业生涯开始于法兴资产的量化研究员一职,主要负责组合保险策略以及基金权证方面的研究工作。2006年,Lasserre先生作为量化工程师加入法兴资产另类投资的产品设计团队,负责为共同基金以及对冲基金的结构化产品定价。Lasserre先生拥有巴黎第七大学的金融数学博士学位。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化,成熟市场动量优选证券投资基金在短期内出现过持有的ETF市值占基金资产净值比例高于95%的情况。发生此类情况后,该基金均在合理期限内得到了调整,没有给投资人带来额外风险或损失。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制,确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求,分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差;分析结果未发现异常情况。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,基金管理人未发生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%。

本报告期内,本基金未发现异常交易行为。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

我们在报告期间,维持了对美国股市的重仓配置,主要是基于对美国经济基本面持续改善的看好。实际上,四月以来,随着严寒天气负面影响的减弱,美国的经济数据一直在反弹,非农就业人数连续两个月超越预期,失业率回到了6.3%的低水准,其他一系列经济数据也显示增长在加速,这些导致了美股在二季度表现靓丽。此外,美联储在最近的几次议息会议中语气都比较温和,QE减码也并没有加速进行,目前市场普遍预期联储首次加息可能会等到15年下半年,流动性依然充裕,这些都有利于美股后续的继续走高。

美国股市之外,基金还曾经重仓了欧洲股票,主要是基于欧央行可能推行宽松的货币政策从而有助于欧洲整体经济复苏的考虑。事实上,正如我们所料,欧央行在六月的议息会议上推出了包括负利率在内的一系列宽松政策,并且宣布可能在年内启动欧版QE。但是欧洲近期的经济数据普遍偏弱,这影响了欧股在二季度的走势。考虑到宽松的货币政策对于经济的刺激作用可能要等待一段时期才能见到,而六月议息会议后可能会出现一段时期的政策空白,因此我们降低了对欧洲的股票配置。对于日本股市,我们出于对日本经济复苏的不确定性,在一季度减仓之后二季度也并没有加仓。

出于对市场波动性加大的担忧,基金在二季度保持了美国债券的仓位,这一配置为基金带来了部分正收益并降低了基金的整体波动率。而随着美国QE减码可能带来的流动性锐减担心的减弱,亚太地区近期股市表现不错,我们会择机增加这部分的资产配置。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截止至本报告期末,本报告期内基金份额净值增长率为2.56%,同期业绩比较基准收益率为3.59%,基金表现落后于业绩比较基准1.03%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年后续,我们认为美国经济增长的确定性比较高,下半年的GDP增速应该在3%之上,主要动力来自于房地产市场的进一步复苏和由于失业率下降而带来的消费增长。因此我们对2014年后续的美国股市继续谨慎乐观。但是考虑到美股一年来涨幅已经很大,我们并不准备过度增加我们在美股上的配置,我们会给予亚太地区和欧洲地区股市适度的关注,并择机加仓。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:普通股	-	-
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	24,170,327.29	87.16
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,837,446.91	10.23
8	其他资产	722,457.78	2.61
9	合计	27,730,231.98	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	SPDR S&P 500 ETF TRUST	ETF基金	开放式	State Street Bank and Trust Company	3,010,565.04	11.41
2	POWERSHARES QQQ NASDAQ 100	ETF基金	开放式	Invesco PowerShares Capital Mgmt LLC	2,022,333.07	7.66
3	ISHARES BARCLAYS 7-10 YEAR	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	1,497,671.51	5.67
4	ISHARES BARCLAYS 10-20 YEAR	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	1,431,116.67	5.42
5	Vanguard FTSE Pacific ETF	ETF基金	开放式	The Vanguard Group	1,378,620.98	5.22
6	ISHARES MSCI PACIFIC EX JPN	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	1,333,311.76	5.05
7	ISHARES BARCLAYS 20+ YEAR TR	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	1,327,085.13	5.03
8	ISHARES MSCI SINGAPORE	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	1,322,655.11	5.01
9	WisdomTree Asia-Pacific ex-Japan Fund	ETF基金	开放式	WisdomTree Asset Management Inc	1,305,021.19	4.94
10	ISHARES MSCI AUSTRALIA INDEX	ETF基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	1,286,181.31	4.87

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序需特别说明。

5.10.2

本基金不投资股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	628,099.25
3	应收股利	91,783.72
4	应收利息	198.04
5	应收申购款	2,376.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	722,457.78

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.10.6 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,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	28,697,503.90
报告期期间基金总申购份额	80,262.78
减:报告期期间基金总赎回份额	3,477,562.74
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	25,300,203.94

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响影响投资者决策的其他重要信息

本基金资产规模低于5000万,对于基金的投资运作管理带来一定影响,敬请投资者注意风险。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

中国证监会批准基金设立的文件;
华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金基金合同;
华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金招募说明书;
华宝兴业成熟市场动量优选证券投资基金托管协议;
基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;
基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告;
基金托管人业务资格批件和营业执照。

9.2 存放地点

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

9.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站,查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司
2014年7月18日

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

2014 第二季度报告

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:2014年07月18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2014年7月16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2014年4月1日起至6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
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3月22日
报告期末基金份额总额	61,368,109.29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(2014年04月01日-2014年06月30日)
1.本期已实现收益	-246,424.57
2.本期利润	635,661.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.0101
4.期末基金资产净值	54,714,606.80
5.期末基金份额净值	0.892

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④	①-③	②-④
过去三个月	1.25%	0.79%	0.49%	0.80%	0.76%	-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;

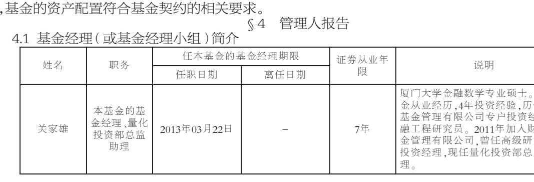
(2)本基金的业绩比较基准为:中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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

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3月22日-2014年6月30日)



注:(1)本基金合同生效日为2013年3月22日;

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

§4 管理人报告

4.1 基金经理(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		
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。6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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《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、事中和事后三个环节,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,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平或涉嫌异常交易的情况。

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债券回购交易除外)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 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度,发达国家经济复苏明显,货币政策出现分化,美国进一步缩减QE,欧元区推出负利率政策;新兴国家逐渐平稳,中国推出定向降准等结构性微刺激,但巴西、俄罗斯等国试图通过加息抑制通胀。国内经济继续疲弱,房地产投资下滑,促使政府陆续推出定向降准和限购放松等定向刺激政策,短期经济出现企稳,PMI指数反弹,工业增加值回升。中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数二季度低位震荡,报告期内微幅上涨0.5%。

报告期内,本基金在操作上主要是从跟踪指数的角度出发,进行被动资产投资。结合指数低位震荡的特点,适当运用量化策略进行增强。截至报告期末,符合基金合同的要求,达到被动跟踪良好控制跟踪误差的目的,并获得了一定的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2014年2季度,本基金净值增长率为1.25%,业绩比较基准增长率为0.49%,跑赢业绩比较基准0.76%。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 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年3季度,已公布的5、6月份PMI数据创出新高,微刺激政策带来库存回补,一定程度上遏制了经济增速的下滑并带动了市场反弹。该状态与美国Q1时期比较相似,财政刺激,货币有放松趋势,经济还在底部。政策托底限制了市场进一步下行的风险,除非发生不可控制的信用风险,市场大幅下行的概率不大。就中证财通可持续发展100指数基金而言,其主题就是关注人本偏向的投资机会,保护环境、关注社会责任的企业代表着中国经济未来的发展方向。就中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数成份股而言,高分红、低估值的特性依然凸显,存在相当数量的受益于金融与国有企业改革、自贸区改革和城镇化推进等良好因素的核心股票,中长期具有明显投资价值,是投资者长期配置的品种。

我们将严格按照基金合同的规定,以被动投资为主,量化增强为辅,继续努力尽责地做好本基金的管理工作,尽力为投资者投资可持续主题提供良好的投资标的和合理的超额收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	50,647,045.16	92.00
	其中:股票	50,647,045.16	92.00
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	4,385,391.11	7.97
8	其他各项资产	18,222.83	0.03
9	合计	55,050,659.10	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末(指数投资)按行业分类的股票投资组合

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	3,894,700.09	7.12
C	制造业	20,246,031.43	37.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,393,438.34	2.55
E	建筑业	3,647,303.73	6.67
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,955,977.45	5.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	873,961.86	1.60
J	金融业	8,769,680.43	16.03
K	房地产业	1,944,044.86	3.55
L	租赁和商务服务业	412,329.22	0.75
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	364,822.38	0.67
	合计	44,502,289.79	81.34

5.2.2 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	80,964.00	0.15
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,107,542.55	7.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	446,695.80	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	6,132.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	607,101.12	1.11
J	金融业	5,973.00	0.01
K	房地产业	752,226.90	1.37
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	138,120.00	0.25
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	6,144,755.37	11.23

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	占基金资产净值比例(%)
1	600383	金地集团	72,921	648,267.69	1.18
2	601390	中国中铁	239,103	616,885.74	1.13
3	600549	厦门钨业	23,799	604,494.60	1.10
4	600519	贵州茅台	4,063	576,864.74	1.05
5	002304	洋河股份	11,301	573,525.75	1.05
6	600497	驰宏锌锗	62,074	571,701.54	1.04
7	000651	格力电器	19,163	564,350.35	1.03
8	601818	光大银行	218,596	555,233.84	1.01
9	000725	京东方A	253,838	550,828.46	1.01
10	000858	五粮液	30,557	547,887.01	1.00

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	占基金资产净值比例(%)
1	600604	市北高新	36,400	379,288.00	0.69
2	300037	新宙邦	10,310	374,253.00	0.68
3	000839	中信国安	45,000	342,000.00	0.63
4	002484	江海股份	18,146	336,789.76	0.62
5	002172	澳洋科技	60,600	304,212.00	0.56

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 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	17,317.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	905.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,222.83

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

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	600604	市北高新	379,288.00	0.69	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

本报告期期初基金份额总额	64,912,716.28
本报告期基金总申购份额	474,886.68
减:本报告期基金总赎回份额	4,019,493.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	61,368,109.29

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

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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、2014年4月16日披露了《杭州天目山药业股份有限公司简式权益变动报告书》;

2、2014年4月21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2014年第1季度报告》;

3、2014年4月24日披露了《杭州天目山药业股份有限公司简式权益变动报告书(更新后)》;

4、2014年4月30日披露了《中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数增强型证券投资基金更新招募说明书(2014年第1号)》及其摘要;

5、2014年5月13日披露了《上海现代制药股份有限公司简式权益变动报告书》;

6、2014年6月3日披露了《财通基金管理有限公司关于北京分公司设立的公告》;

7、2014年7月1日披露了《中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数增强型基金2014年年中资产净值的公告》;

8、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
二〇一四年七月十八日