

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]第三季度报告

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10月27日

基金管理人和基金托管人承诺本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对本基金的内容的真实性、准确性和完整性承担个别和连带责任。

基金托管人上海银行股份有限公司承诺本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对本基金的内容的真实性、准确性和完整性承担个别和连带责任。

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基金合同。

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7月1日至2014年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

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

基金代码:000402

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2013年10月22日

报告期末基金份额总额:44,694,720.70份

基金类别:股票型基金

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

报告期:2014年7月1日至2014年9月30日止。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2014年07月01日-2014年09月30日)

1.本期实现收益 1,335,640.54

2.本期利润 8,464,204.38

3.期初现金及现金等价物余额 0.1462

4.期末现金及现金等价物余额 46,268,540.67

5.期末现金及现金等价物余额 1,035

注:1. (1)所涉及基金的业绩报酬不包括持有人认购或交易基金的费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
(2)本期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减去本期公允价值变动收益。
(3)基金净值增长率为基金份额净值除以期初基金份额净值。

3.2.1 本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 累计净值增长 业绩比较基准收益率差额 ①-③ ②-④

过去三个月 0.83% 15.12% 0.86% 0.91% -0.03%

注:1. 本基金在定期报告中不披露持有人买卖基金的费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
(1)本基金的业绩报酬比例为:当期利润的10%归入基金资产, 其余部分按100%归入基金份额持有人(税后) x 5%。
3.2.2 本基金因生息而以基金份额净值除以期初基金份额净值计算的业绩报酬比例
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的比
较基准:中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数

(3.2.1) 2013年7月22日-2014年9月30日止。

注:(1)本基金合同生效日为2013年7月22日。
(2)本基金投资于中证财通中国可持续发展100(ECPI ESG)指数成份股和构造成份的股票, 占基金资产比例>80%;投资于权证、股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品的比例不超过基金资产净值的10%;本基金的建仓期为2013年7月22日至2013年10月22日, 在建仓期内本基金未达到基金合同要求。
§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人(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

本基金的基金经理:吴黎黎, 负责本基金的日常投资管理, 2013年3月22日至今。

本基金的基金经理:郑超超, 负责本基金的日常投资管理, 2012年10月19日至今。

4.2 本基金投资策略

本基金投资策略:本基金将通过深入的行业研究, 公司治理和严格的内部控制, 通过严格的产品内制和操作体系, 保证研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的独立性。公司坚持投资管理相对独立的原则, 投资决策和投资运作由投资决策委员会负责, 在投资决策委员会的统一领导下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.3 公平交易制度的执行情况

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.4 报告期内基金的费用情况

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.5 投资组合报告

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.6 报告期内基金的资产配置情况

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.7 基金管理人运用基金的表决权的情况

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.8 报告期内基金的分红情况

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.9 报告期内基金的费用调整情况

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.10 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.11 报告期内基金的会计政策、会计估计变更

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.12 报告期内基金的证券投资限制政策

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.13 报告期内基金的融资融券交易情况

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.14 报告期内基金的资产支持证券投资情况

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.15 报告期内基金的国债期货投资情况

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.16 报告期内基金的股票期权投资情况

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.17 报告期内基金的权证投资情况

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.18 报告期内基金的资产配置比例

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.19 报告期内基金的税收成本

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.20 报告期内基金的费用调整情况

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.21 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.22 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.23 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.24 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.25 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.26 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.27 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.28 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.29 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.30 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.31 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.32 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.33 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.34 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.35 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.36 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.37 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.38 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.39 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.40 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.41 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制。

4.42 报告期内基金的其他重大事件

本基金将通过建立公平交易制度, 为所有投资组合提供公平的交易机会, 在投资决策、研究、交易、风险管理、合规、风控等部门的制衡机制下, 建立健全