

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

[2015] 第三季度报告

基金管理人:中证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:2015年10月26日
1.1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员声明对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。
本基金托管人上海银行股份有限公司声明对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。
基金过往业绩并不代表其未来表现,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。
本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

1.2 基金产品概况

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		-	-
C 制造业		119,563,633	0.47
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		-	-
G 交通运输、仓储和邮政业		-	-
H 餐饮和住宿业		-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业		-	-
J 金融业		-	-
K 房地产业		1,054,000,000	4.10
L 租赁和商务服务业		-	-
M 科学研究、技术服务和地质勘查业		-	-
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 卫生和计划生育		-	-
R 文化、体育和娱乐业		-	-
S 综合		-	-
合计		1,173,563,633	4.64

6.3 本期末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

基金管理人声明本基金持有的股票,属较低风险、较高收益的证券投资基金,并将其纳入本基金的估值方法。

本基金的估值方法:在估值日,对于有活跃市场的股票,按估值日的收盘价估值;对于没有活跃市场的股票,按最近交易日后最近一个交易日的收盘价估值;对于暂停交易的股票,按最近交易日前一个交易日的收盘价估值。

投资策略:本基金主要投资于具有良好基本面的股票,力求在控制风险的前提下,获取稳定的资本增值。

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%+银行存款利息*5%。

风险收益特征:本基金为股票型证券投资基金,在力求实现基金资产长期增值的前提下,力争获得高于同期银行存款利率的收益。

基金管理人:中证财通基金管理有限公司

5.3 主要财务指标

报告期(2015年07月01日-2015年09月30日)

1.本期已实现收益 92,077,000

2.本期利润 -7,875,646,035

3.期初至报告期期末的利润 26,311,712,035

4.期末基金资产净值 1,054,000,000

5.报告期净值收益率 -0.405%

6.报告期净值收益率标准差 0.051%

7.报告期期间平均净值收益率 -0.050%

8.报告期期间平均净值收益率标准差 0.050%

9.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额 -0.050%

10.报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 0.050%

11.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率 -0.050%

12.报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差/报告期净值收益率 -0.050%

13.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

14.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

15.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

16.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

17.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

18.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

19.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

20.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

21.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

22.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

23.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

24.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

25.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

26.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

27.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

28.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

29.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

30.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

31.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

32.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

33.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

34.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

35.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

36.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

37.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

38.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

39.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

40.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

41.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

42.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

43.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

44.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

45.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

46.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

47.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

48.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

49.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

50.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

51.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

52.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

53.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

54.管理人报告

5.4.1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员声明对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。

本基金托管人上海银行股份有限公司声明对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。

基金过往业绩并不代表其未来表现,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

5.4.2 基金产品概况

报告期(2015年07月01日-2015年09月30日)

1.本期已实现收益 92,077,000

2.本期利润 -7,875,646,035

3.期初至报告期期末的利润 26,311,712,035

4.期末基金资产净值 1,054,000,000

5.报告期净值收益率 -0.405%

6.报告期净值收益率标准差 0.051%

7.报告期期间平均净值收益率 -0.050%

8.报告期期间平均净值收益率标准差 0.050%

9.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额 -0.050%

10.报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 0.050%

11.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

12.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

13.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

14.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

15.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

16.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

17.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

18.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

19.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

20.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

21.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

22.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

23.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

24.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

25.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

26.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

27.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

28.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

29.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

30.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

31.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

32.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

33.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期基准收益率的标准差 -0.050%

34.报告期净值收益率与同期基准收益率的差额/报告期净值收益率与同期