

## 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 半年度 报告摘要

2014年6月30日

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。

根据相关法律法规及《基金合同》的要求,结合本基金运作情况,本报告期内本基金未进行利润分配。

#### 5.5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵照《证券投资基金法》及其他法律法规、《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》和《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》的有关规定,诚实、尽责地履行了基金托管人义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人报告期内本基金投资运作遵守了净值计算、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、托管协议的约定,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。

5.3 托管人对本报告期内基金财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告期内财务指标、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,认为其编制内容真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

#### 5.6 半年度财务会计报告(未经审计)

会计报表截止:2014年06月30日  
单位:人民币元

资产	附注号	本期末	
		2014年06月30日	2013年12月31日
银行存款	6.4.7.1	4,257,770.55	3,055,460.91
结算备付金		127,520.68	90,456.13
存出保证金		17,317.74	11,208.18
交易性金融资产	6.4.7.2	50,647,045.16	58,259,367.05
其中:股票投资		50,647,045.16	58,259,367.05
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.3	-	1,500,000.00
应收利息	6.4.7.4	141,843.66	141,843.66
应收股利	6.4.7.5	905.09	962.90
应收申购款		-	2,277.42
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		55,050,659.10	63,163,285.25

负债和所有者权益	附注号	本期末	
		2014年06月30日	2013年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
应付利息	6.4.7.3	-	-
应付股利		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付债券		41.63	99,977.45
应付赎回款		53,607.60	-
应付管理人报酬		44,508.08	55,088.24
应付托管费		6,680.99	8,262.93
应付交易费用	6.4.7.7	57,046.41	21,482.02
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付股利		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	174,075.26	290,000.00
负债合计		336,052.30	474,808.64
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	61,368,109.29	66,317,901.24
未分配利润	6.4.7.10	-6,653,502.49	-3,629,424.63
所有者权益合计		54,714,606.80	62,688,476.61
负债和所有者权益总计		55,050,659.10	63,163,285.25

注:(1)资产负债表附注为基金会计报表的组成部分;  
(2)截至截止日2014年6月30日,基金份额净值0.892元,基金份额总额61,368,109.29份。

6.2 利润分配  
会计截止: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:2014年01月01日-2014年06月30日

项目	附注号	本期	
		2014年01月01日至2014年06月30日	2013年01月01日至2013年06月30日
一、收入		-2,950,156.21	4,938,374.33
1.利息收入		190,621.62	716,666.44
其中:存款利息收入	6.4.7.11	14,565.86	78,155.66
债券利息收入		-	-
资产支持证券投资收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,052.76	639,850.78
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-786,174.09	2,310,816.78
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-1,305,808.16	1,650,851.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
公允价值变动收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
其他公允价值变动收益	6.4.7.15	519,634.07	659,965.31
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-2,190,001.01	-8,177,529.00
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	5,400.27	21,129.35
减:二、费用		6,090,885	949,087.49
1.管理人报酬		283,543.96	408,887.10
2.托管费		42,531.54	61,333.09
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	69,624.91	341,898.67
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
其他交易费用		-	-
5.利息支出(损失以“-”号填列)		-	-
6.其他费用	6.4.7.19	21,201.04	136,968.63
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-3,560,586.06	-5,887,461.82
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-3,560,586.06	-5,887,461.82

注:(1)后附会计报表附注为基金会计报表的组成部分;  
(2)本基金于2013年3月22日成立,因此利润表上年度可比期间只列示自基金合同生效日至2013年3月30日数据,特此说明。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表  
会计截止: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:2014年01月01日-2014年06月30日

项目	附注号	本期	
		2014年01月01日至2014年06月30日	2013年01月01日至2013年06月30日
一、收入		-2,950,156.21	4,938,374.33
1.利息收入		190,621.62	716,666.44
其中:存款利息收入	6.4.7.11	14,565.86	78,155.66
债券利息收入		-	-
资产支持证券投资收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,052.76	639,850.78
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-786,174.09	2,310,816.78
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-1,305,808.16	1,650,851.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
公允价值变动收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
其他公允价值变动收益	6.4.7.15	519,634.07	659,965.31
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-2,190,001.01	-8,177,529.00
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	5,400.27	21,129.35
减:二、费用		6,090,885	949,087.49
1.管理人报酬		283,543.96	408,887.10
2.托管费		42,531.54	61,333.09
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	69,624.91	341,898.67
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
其他交易费用		-	-
5.利息支出(损失以“-”号填列)		-	-
6.其他费用	6.4.7.19	21,201.04	136,968.63
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-3,560,586.06	-5,887,461.82
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-3,560,586.06	-5,887,461.82

注:(1)后附会计报表附注为基金会计报表的组成部分;  
(2)本基金于2013年3月22日成立,因此利润表上年度可比期间只列示自基金合同生效日至2013年3月30日数据,特此说明。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表  
会计截止: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:2014年01月01日-2014年06月30日

项目	附注号	本期	
		2014年01月01日至2014年06月30日	2013年01月01日至2013年06月30日
一、收入		-2,950,156.21	4,938,374.33
1.利息收入		190,621.62	716,666.44
其中:存款利息收入	6.4.7.11	14,565.86	78,155.66
债券利息收入		-	-
资产支持证券投资收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,052.76	639,850.78
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-786,174.09	2,310,816.78
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-1,305,808.16	1,650,851.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
公允价值变动收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
其他公允价值变动收益	6.4.7.15	519,634.07	659,965.31
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-2,190,001.01	-8,177,529.00
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	5,400.27	21,129.35
减:二、费用		6,090,885	949,087.49
1.管理人报酬		283,543.96	408,887.10
2.托管费		42,531.54	61,333.09
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	69,624.91	341,898.67
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
其他交易费用		-	-
5.利息支出(损失以“-”号填列)		-	-
6.其他费用	6.4.7.19	21,201.04	136,968.63
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-3,560,586.06	-5,887,461.82
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-3,560,586.06	-5,887,461.82

注:(1)后附会计报表附注为基金会计报表的组成部分;  
(2)本基金于2013年3月22日成立,因此利润表上年度可比期间只列示自基金合同生效日至2013年3月30日数据,特此说明。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表  
会计截止: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:2014年01月01日-2014年06月30日

项目	附注号	本期	
		2014年01月01日至2014年06月30日	2013年01月01日至2013年06月30日
一、收入		-2,950,156.21	4,938,374.33
1.利息收入		190,621.62	716,666.44
其中:存款利息收入	6.4.7.11	14,565.86	78,155.66
债券利息收入		-	-
资产支持证券投资收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,052.76	639,850.78
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-786,174.09	2,310,816.78
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-1,305,808.16	1,650,851.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
公允价值变动收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
其他公允价值变动收益	6.4.7.15	519,634.07	659,965.31
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-2,190,001.01	-8,177,529.00
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	5,400.27	21,129.35
减:二、费用		6,090,885	949,087.49
1.管理人报酬		283,543.96	408,887.10
2.托管费		42,531.54	61,333.09
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	69,624.91	341,898.67
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
其他交易费用		-	-
5.利息支出(损失以“-”号填列)		-	-
6.其他费用	6.4.7.19	21,201.04	136,968.63
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-3,560,586.06	-5,887,461.82
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-3,560,586.06	-5,887,461.82

注:(1)后附会计报表附注为基金会计报表的组成部分;  
(2)本基金于2013年3月22日成立,因此所有者权益变动表上年度可比期间只列示自基金合同生效日至2013年3月30日数据,特此说明。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表  
会计截止: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:2014年01月01日-2014年06月30日

项目	附注号	本期	
		2014年01月01日至2014年06月30日	2013年01月01日至2013年06月30日
一、收入		-2,950,156.21	4,938,374.33
1.利息收入		190,621.62	716,666.44
其中:存款利息收入	6.4.7.11	14,565.86	78,155.66
债券利息收入		-	-
资产支持证券投资收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,052.76	639,850.78
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-786,174.09	2,310,816.78
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-1,305,808.16	1,650,851.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
公允价值变动收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
其他公允价值变动收益	6.4.7.15	519,634.07	659,965.31
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-2,190,001.01	-8,177,529.00
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	5,400.27	21,129.35
减:二、费用		6,090,885	949,087.49
1.管理人报酬		283,543.96	408,887.10
2.托管费		42,531.54	61,333.09
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	69,624.91	341,898.67
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
其他交易费用		-	-
5.利息支出(损失以“-”号填列)		-	-
6.其他费用	6.4.7.19	21,201.04	136,968.63
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-3,560,586.06	-5,887,461.82
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-3,560,586.06	-5,887,461.82

注:(1)后附会计报表附注为基金会计报表的组成部分;  
(2)本基金于2013年3月22日成立,因此所有者权益变动表上年度可比期间只列示自基金合同生效日至2013年3月30日数据,特此说明。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表  
会计截止: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:2014年01月01日-2014年06月30日

项目	附注号	本期	
		2014年01月01日至2014年06月30日	2013年01月01日至2013年