财通收益增强债券型证券投资基金

2018 第二季度 报告

2018年6月30日

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年07月20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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月18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。
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:财通收益增强债券C,基金代码:003204,基金份额持有人持有的原份额变更为A类份额,基金简称:财通收益增强债券A,基金代码:720003。
本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	财通收益增强债券
场内简称	-
基金主代码	720003
交易代码	-
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2012年12月20日
报告期末基金份额总额	24,654,999.50份
投资目标	在保持资产流动性和严格控制风险的基础上,综合利用多种投资策略,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金长期战略性资产配置以债券为主,同时,在不同的市场条件下,本基金将综合考虑宏观环境、公司基本面、市场估值水平以及投资者情绪,在一定的范围内对债券、股票和现金各自的投资比例作战术性资产配置调整,以降低系统性风险对基金收益的影响。 债券资产投资策略层面,本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资。主要投资策略包括债券投资组合策略和动态品种优化策略;股票投资策略层面,本基金以价值投资为基本投资理念,结合定性分析与定量分析的结果,以价值选股,组合投资为原则,选择具备估值吸引力、增长潜力显著的公司股票构建本基金的股票投资组合;本基金在权证投资方面主要运用的策略包括价值发现策略和套利交易策略等;如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他衍生金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,本基金对衍生金融工具的投资主要以对冲投资风险或无风险套利为主要目的。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	财通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	财通收益增强债券A / 财通收益增强债券C
下属分级基金的场内简称	- / -
下属分级基金的交易代码	720003 / 003204
报告期末下属分级基金的份额总额	24,654,899.06份 / 100.44份
下属分级基金的风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。 / 本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

注:(1)本基金合同生效日为2012年12月20日,根据基金合同规定,第一个保本周期到期日为2015年12月21日,本基金于2015年12月23日转型为非保本的债券型证券投资基金;
(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 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(2018年04月01日 - 2018年06月30日)	
	财通收益增强债券A	财通收益增强债券C
1.本期已实现收益	-103,553.73	51,639.30
2.本期利润	-315,653.07	22,305.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0126	0.0060
4.期末基金资产净值	30,063,577.56	98.08
5.期末基金份额净值	1.2194	0.9765

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)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 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

财通收益增强债券A净值表现

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	-1.05%	0.20%	1.01%	0.10%	-2.06%	0.10%

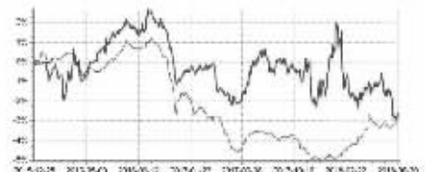
财通收益增强债券C净值表现

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	-1.27%	0.20%	1.01%	0.10%	-2.28%	0.10%

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)本基金业绩比较基准为:中债综合指数收益率。
(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。

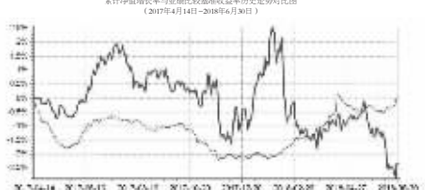
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

财通收益增强债券型证券投资基金A
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年12月25日-2018年6月30日)



注:(1)本基金合同生效日为2012年12月20日,根据合同规定,第一个保本周期到期日为2015年12月21日,本基金于2015年12月25日转型为非保本的债券型证券投资基金;
(2)本基金种类为非保本的债券型证券投资基金,股票、权证等权益类占基金资产≤20%;债券等固定收益类资产占基金资产≥80%;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≥5%,权证占基金资产净值≤3%。本基金的建仓期为2015年12月25日至2016年6月25日,截至建仓期末,基金的资产配置符合基金契约的相关要求。
截至报告期末,基金的资产配置符合基金契约的相关要求;
(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。

财通收益增强债券型证券投资基金C
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年4月14日-2018年6月30日)



注:(1)本基金合同生效日为2012年12月20日,根据合同规定,第一个保本周期到期日为2015年12月21日,本基金于2015年12月25日转型为非保本的债券型证券投资基金;
(2)本基金种类为非保本的债券型证券投资基金,股票、权证等权益类占基金资产≤20%;债券等固定收益类资产占基金资产≥80%;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≥5%,权证占基金资产净值≤3%。本基金的建仓期为2015年12月25日至2016年6月25日,截至建仓期末,基金的资产配置符合基金契约的相关要求。
截至报告期末,基金的资产配置符合基金契约的相关要求。
(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 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		
张亦博	本基金的基金经理	2015年08月27日	-	7年	澳大利亚昆士兰大学风险管理学硕士,特许金融分析师(CFA),历任德邦证券有限责任公司研究所研究员;东吴证券股份有限公司资产管理总部债券研究员,债券投资经理助理,华安证券有限责任公司资产管理部固定收益投资经理。2015年8月加入财通基金管理有限公司,任固定收益部基金经理。

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"分别为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遵规守信情况说明

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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、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于备选库,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对象备选库和交易对于备选库,进而根据投资授权权限具体的投资组合,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。

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,未发现基金间存在违背公平交易原则的行为或异常交易行为。

4.3.3 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。

本报告期内为主动型开放式基金,本报告期内,本投资组合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 报告期内基金投资策略和运作分析

今年在美信用和非标收紧的大环境下,信用风险将明显上升,中低等级民企债券将面临信用风险和流动性风险的双重打压,因此组合在信用债上重点关注国企龙头高等级的产业债投资组合,基本面有所下降,叠加资本成本等因素,利率债趋势明确,本基金当参与利率交易提升收益率,并保持适当杠杆水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止到2018年6月30日,本基金A类份额份额净值为1.2194元,报告期内净值增长率为-1.05%,业绩比较基准收益率为1.01%,低于业绩比较基准2.06%;C类份额单位净值为0.9765元,报告期内净值增长率为-1.27%,业绩比较基准收益率为1.01%,低于业绩比较基准2.28%。

报告期内基金持有人数或基金份额净值预警说明

报告期内,本基金未有连续20个交易日基金份额持有人数量不满200人的情况出现;本基金份额净值连续于2018年1月23日至2018年4月12日期间连续34个工作日低于5000万元,并于2018年4月13日恢复至5000万元以上,于2018年4月16日再次低于5000万元,截至报告期末,已连续53个工作日,本基金管理人将持续关注本基金资产净值情况,并将严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和维护。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,940,545.40	6.28
	其中:股票	1,940,545.40	6.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	27,573,792.70	89.24
	其中:债券	27,573,792.70	89.24
	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	925,287.97	2.99
8	其他资产	458,285.42	1.48
9	合计	30,897,911.49	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)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	880,784.40	2.93
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	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,059,761.00	3.53
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,940,545.40	6.45

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。

5.3 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投资明细

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	300059	东方财富	31,000	408,580.00	1.36
2	600845	宝信软件	12,400	326,740.00	1.09
3	002410	广联达	11,700	324,441.00	1.08
4	000596	古井贡酒	3,600	319,608.00	1.06
5	600887	伊利股份	11,200	312,480.00	1.04
6	600519	贵州茅台	340	248,696.40	0.83

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,717,014.00	12.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,266,676.60	14.19
	其中:政策性金融债	4,266,676.60	14.19
4	企业债券	13,469,650.10	44.80
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	6,120,452.00	20.36
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	27,573,792.70	91.72

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010107	21国债(7)	36,370	3,717,014.00	12.36
2	112321	16北辰01	30,000	2,980,800.00	9.91
3	112257	15荣盛02	30,000	2,948,100.00	9.81
4	018006	国开1702	26,780	2,668,627.00	8.88
5	136078	15鸣润01	26,000	2,583,880.00	8.59

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
本基金不投资股指期货。
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合约。
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合约。
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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	32,910.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,206.05
5	应收申购款	31,767.58
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	65,884.42

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601390	中国中铁	2,311,218.00	2.54	重大资产重组

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
本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。
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

	财通指数100号A	财通指数100号C
报告期期初基金份额总额	56,979,039.94	0.00
报告期期间基金总申购份额	1,225,096.47	0.00
减:报告期期间基金总赎回份额	582,300.40	0.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	57,621,836.01	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) 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。

§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

	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
报告期期初管理人持有的本基金份额	1,828,670.63	-
报告期期间买入申购总份额	-	-
报告期期间卖出赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,828,670.63	-
报告期期末持有的基金份额比例(%)	3.17%	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2015年07月08日	1,828,670.63	3,000,000.00	0.40%
合计			1,828,670.63	3,000,000.00	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期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	2017-03-15至2018-6-30	33,533,869.89	0.00	0.00	33,533,869.89	58.20%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

目标投资组合股票市场平均回报偏离风险:目标投资组合的风险;基金投资组合回报与目标投资组合回报偏离的风险;目标投资变更的风险。
在报告期内,本基金单一投资者持有的基金份额比超过20%,可能对基金运作造成如下风险:
(1)赎回申请延缓支付的风险
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,很可能导致基规模小,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。

§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.关于证券财通中证可持续发展100(ECPI ESG)指数增强型证券投资基金基金合同;
3.关于证券财通中证可持续发展100(ECPI ESG)指数增强型证券投资基金托管协议;
4.关于证券财通中证可持续发展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
二〇一八年七月二十日

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

2018 第二季度 报告

2018年6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
报告送出日期:2018年07月20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2018年7月19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。
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。
本报告期自2018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	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	
报告期末基金份额总额	57,621,836.01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在线进行收益增强和风险控制,力争实现超越该指数的收益水平。	
投资策略	本基金将全额比较基准的跟踪目标是:力争使基金净值增长率与全额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%。 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	
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	57,621,836.01份	0.00份
下属分级基金的风险收益特征	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。	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。

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 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(2018年04月01日 - 2018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
1.本期已实现收益	431,196.36	0.00
2.本期利润	-5,654,091.16	0.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0988	-
4.期末基金资产净值	90,936,353.27	0.00
5.期末基金份额净值	1.5782	1.0000

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) 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,C类份额初始净值为1.0000元;
(4)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 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

中证财通可持续发展100指数A净值表现

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	-5.87%	1.05%	-9.94%	1.02%	4.07%	0.03%

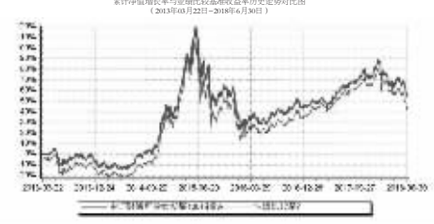
中证财通可持续发展100指数C净值表现

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	0.00%	0.00%	-9.94%	1.02%	9.94%	-1.02%

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。

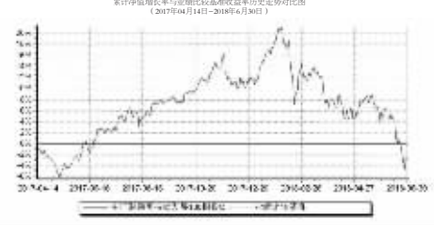
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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A
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03月22日-2018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;
(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。

中证财通中国可持续发展100指数C
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年04月14日-2018年6月30日)



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		
吴迪	本基金的基金经理	2016年04月21日	-	7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,历任战略产品部产品经理、量化投资部研究员、见习基金经理助理基金经理。
苏陟杰	本基金的基金经理、量化投资一部总监助理	2018年11月31日	-	5年	清华大学学士、美国芝加哥大学金融数学硕士、CFA,历任MSCI Inc.分析员、华泰柏瑞基金量化投资部研究员、专户投资经理。2017年7月加入财通基金,现任量化投资一部总监助理。

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"分别为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遵规守信情况说明

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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、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于备选库,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对象备选库和交易对于备选库,进而根据投资授权权限具体的投资组合,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。

报告期内为主动型开放式基金,本报告期内,本投资组合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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度,在贸易战、金融去杠杆和经济下行预期的多重影响下,市场不断震荡下行,分板块看,强周期性行业和科技类行业均表现不佳;大市蓝公司整体表现较优,类资源类公司在信用债上重点关注国企龙头高等级的产业债投资组合,基本面有所下降,叠加资本成本等因素,利率债趋势明确,本基金当参与利率交易提升收益率,并保持适当杠杆水平。

报告期内,本基金实施了增强策略,并积极参与新股申购,增强效果尚可,基金净值较业绩基准有较为明显的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止到2018年6月30日,本基金A类份额份额净值为0.526元;本报告期内,基金份额净值增长率为-8.68%,同期业绩比较基准收益率为-5.43%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金份额净值预警说明

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 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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	532,979,625.80	74.63