（上接B37版）

传真:021-20539999
客服电话:400-820-1515
网址:http://www.zhengtongfunds.com/
(103) 北京电盈基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1号楼36层3603室
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦F座12B
法人代表:曲馨月
联系人:周静华
传真:010-56176117
客服电话:400-100-3391
公司网址:www.bjdyfund.com
(104) 天津万家财富资产管理有限公司
注册地址:天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室
办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层
法人代表:李修辞
联系人：王芳芳
电话:010-59013842
清算传真:021-38909635
客服电话:010-59013825
公司网址:http://www.wanjiawealth.com/
(105) 中原银行股份有限公司
注册地址:河南省郑州市郑东新区CBD商务外环路23号中科金座
办公地址:河南省郑州市郑东新区CBD商务外环路23号中科金座
法人代表人:窦荣兴
联系人:赵栋一
电话:0371-85519823
清算传真:0371-85519869
客服电话:95186
公司网址:www.zybank.com.cn
(106)天津市凤凰财富基金销售有限公司
注册地址:天津生态城动漫中路126号动漫大厦C区209（TG第123号）
办公地址:天津市和平区南京路181号世纪都会1606-1607
法人代表人:王正宇
联系人:杨雪研
电话:022-23297867
传真:022-23297867
客服电话:4007-066-880
公司网址:http://www.phoenix-capital.com.cn/
(107)上海爱建财富管理有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号1806-13室
办公地址:上海市肇嘉浜路746号爱建金融大厦102室
法人代表人:马金
联系人:蔡俊
电话:021-64382399
传真:64388012
客服电话:021-64393653
公司网址:www.ajcf.com.cn
(108)有鱼基金销售有限公司
注册地址:上海自由贸易试验区浦东大道2123号3层3E-2655室
办公地址:上海市徐汇区桂平路391号A座五层
法人代表:林琼
联系人:徐海峥
电话:021-64389188
传真:021-64389188-102
客服电话:400-7676-298
公司网址:www.youyufund.com
(109)北京恒宇天泽基金销售有限公司
注册地址:北京市延庆区延庆经济开发区百泉街10号2栋883室
办公地址:北京市东城区东滨河路乙1号航星园8号楼9层
法定代表人:梁越
联系人:王东
电话:13001936144
传真:010-56081694
客服电话:400-188-8848
公司网址:www.1314find.com
(110)扬州国信嘉利基金销售有限公司
注册地址:江苏省扬州市广陵新城信息产业基地3期20B栋
办公地址:江苏省扬州市邗江区文昌西路56号公元国际大厦320
法人代表:刘晓光
联系人:苏曦
电话:0514-82099618
传真:021-68811007
客服电话:400021608
(111)联储证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼
办公地址:深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼
法人代表:沙常明
联系人:丁倩云
电话:01086499427
客服电话:4006206868
公司网址:www.lczq.com
(112)深圳盈信基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1
办公地址:辽宁省大连市中山区南山路155号南山1910小区A3-1
法定代表人:苗宏升
联系人:葛俏俏
座机:0411-66889809
传真:0411-66889827
客服电话:4007-903-688
公司网址:www.fundying.com
(113)南京途牛金融信息服务有限公司
注册地址:南京市玄武区玄武大道699-1号
办公地址:南京市玄武区玄武大道699-1号
法人代表:宋时琳
联系人:张士帅
电话:025-86853969
传真:025-86853999
客服电话:4007-999-999转3
公司网址:http://jr.tuniu.com/

本基金将通过基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售，具体名单见发售公告或相关业务公告。

（二）注册登记机构
名称:财通基金管理有限公司
住所:上海市虹口区吴淞路619号505室
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心41楼
法定代表人:刘未
电话:021-2053 7888
联系人:薛程
（三）出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
法定代表人:韩炯
电话:021-3135 8666
传真:021-3135 8600
联系人:黎明
经办律师:吕红、黎明
（四）审计基金财产的会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
执行事务合伙人:毛鞍宁
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼（东三办公楼）16层
办公地址:上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
公司电话:（021）2228 8888
公司传真:（021）2228 0000
签章会计师:蒋燕华、蔡玉芝
业务联系人:蒋燕华

四、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
五、基金的类型
股票型证券投资基金
六、基金的投资目标
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%。
七、投资范围
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、银行存款、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。其中，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不低于基金资产的80%；投资于权证的资产不超过基金资产净值的3%；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的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
八、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。
1、标的指数
本基金股票资产跟踪的标的指数为中证财通中国可持续发展100（ECPI ESG）指数。该指数是由中证指数公司联合全球著名的可持续发展评级公司ECPI联合开发的基于中国市场的可持续发展指数。成份股主要选自沪深300指数成份股，ECPI公司人员独立对沪深300指数成份股进行跟踪分析，汇总信息，并发送回ECPI的欧洲总部，由专门的专家委员会从环境友好、社会责任、公司治理三个维度按照国际标准进行可持续发展评定，确定中证财通中国可持续发展100（ECPI ESG）指数的成份股。独立而系统的评级方式确保了中证财通中国可持续发展100（ECPI ESG）指数成份股符合国际标准的可持续发展理念，代表中国可持续发展的方向。
如果中证财通中国可持续发展100（ECPI ESG）指数被停止编制及发布，或中证财通中国可持续发展100（ECPI ESG）指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致中证财通中国可持续发展100（ECPI ESG）指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数，而无需召开基金份额持有人大会。
由于上述原因变更标的指数和投资对象，基金管理人在履行适当程序后报中国证监会核准，并在指定媒体上公告。
2、指数化投资和增强策略
本基金主要策略为复制标的指数，投资组合将以成份股在目标指数中的基准权重为基础，并根据财通数量化的多策略体系在有限范围内进行超配或低配。一方面将严格控制组合跟踪误差，避免大幅偏离标的指数，另一方面在指数跟踪的同时力求超越指数。
本基金基于数量化的多策略体系，实现投资策略的多元化，每个策略都根据其投资逻辑实现可量化、可检验。主要策略包括：多因子Alpha策略、配对增强策略、事件驱动型增强策略、风险跟踪控制策略和组合优化策略。
1）多因子Alpha策略
多因子Alpha策略的实施主要基于基金管理人自行开发的财通多因子Alpha模型，该模型是在对中国资本市场进行长期研究的基础上形成的获取长期超额收益的量化决策模型。模型因子包括基本面因子和市场面因子，基本面因子主要包括成长因子、价值因子、估值因子、盈利质量因子，市场面因子主要包括动量因子、强度因子、市场情绪因子。
以上因子综合了来自市场各类投资者、公司各类报表、分析师及监管政策等各方面信息。财通多因子Alpha 模型利用基金管理人长期积累并最新扩展的数据库，科学客观地综合了大量的各类信息。基金经理将根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适时调整各因子类别的具体组成及权重。
2）配对增强策略
配对增强策略是配对交易的对冲策略在中国资本市场的一个创新应用，通过严格的量化分析和研究，就配对策略在中国的应用进行了客观分析，形成了一个系统化交易决策系统，在风险预算的约束下追求超额收益。具体包括对标的指数成份股的协整关系分析、协整关系监测、风险预算和资产分配等子模块，确保配对增强策略实现稳定性、及时性和风险可控性。
3）事件驱动型增强策略
通过系统分析各类事件内在的经济逻辑和蕴含的基本面信息，并做统计分析和研究，以量化投资的手段进行组合管理，获取由事件驱动带来的增强收益。主要事件包括但不限于：大股东增持、业绩预增、分红送转、定向增发、十大流通股东变动等。
4）风险跟踪控制策略
有效跟踪标的指数并控制跟踪误差是指数化投资的首要目标。因此，主动增强须在风险预算下进行。本基金通过自主研究开发的模块化风险分析体系进行风险跟踪，把投资组合风险控制在允许的范围内。
风险跟踪控制策略的重点是关注跟踪误差，包括日内跟踪误差和年化跟踪误差。具体包括关注资产配置偏离度、行业偏离度及个股投资偏离度，预算跟踪误差，防范出现的超出风险控制要求的偏离。除了每日的实时跟踪外，本基金定期（一周、月度、半年、年度）对跟踪误差做系统化分析，并据此进行定期的组合优化。
对于指数增强部分的风险控制主要是风险预算制度。对于每个具体策略，结合其风险收益特征，在风险预算的前提下，进行资产分配，使指数增强部分的风险控制在可接受的范围内追求相应的超额收益。
本基金基于数量化的多策略系统，是在基金管理人自主开发的金融工程量化分析平台上构建的，该平台借鉴国内外先进的量化系统构建开发完成。
3、组合调整策略
本基金所拥建的投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。
A、定期调整
根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对该部分股票投资组合及时进行调整。根据中证指数公司对标的指数成份股进行调整，在考虑跟踪误差要求的基础上对成份股进行恰当的定期调整。
B、不定期调整
1）如果预期目标指数的成份股将会发生调整，本基金管理人将视当时具体情况，在综合考虑跟踪误差和投资者利益的基础上，决定是否提前纳入部分备选成份股；
2）当成份股发生配股、增发、分红等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化对股票投资组合及时进行相应调整；
3）根据本基金的申购和赎回情况，对该部分股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；
4）因标的指数成份股停牌限制、交易量不足等市场流动性因素，使得本基金无法依照标的指数权重购买某些成份股时，本基金管理人将视当时具体情况，在综合考虑跟踪误差和投资者利益的基础上，决定是否买入相关的替代性股票；
5）根据法律法规中针对基金投资比例的相关规定，当基金投资组合中按标的指数权重投资的股票资产比例或个股比例超过规定限制时，本基金将对其进行实时调整，并相应对其他资产或个股进行微调，以保证基金合法规范运作；
6）根据法律法规和《基金合同》的规定，成份股在标的指数中的权重因其它特殊原因发生相应变化的，本基金可以对该部分股票投资组合进行适当变通和调整，并在法律法规允许的范围内辅之以金融衍生产品投资管理等，最终使跟踪误差控制在一定的范围之内。
4、债券投资策略
本基金基于流动性管理等策略性投资的需要，将投资于国债、金融债等流动性好的债券。债券投资的目的是保证基金资产流动性，在股票市场整体走势不看好的前提下，为本基金提供较为安全的投资渠道，从而有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。在综合信用分析、流动性分析、税收及市场结构等因素分析的基础上，本基金主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。
5、权证投资策略
本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合。
6、股指期货投资策略
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。
九、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%
如果中证财通中国可持续发展100（ECPI ESG）指数被停止编制及发布，或中证财通中国可持续发展100（ECPI ESG）指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致中证财通中国可持续发展100（ECPI ESG）指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数，而无需召开基金份额持有人大会。
由于上述原因变更标的指数和投资对象，基金管理人在履行适当程序后报中国证监会核准，并在指定媒体上公告。
十、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。
十一、基金投资组合报告
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。
本报告中财务资料未经审计。本投资组合报告所载数据截至2018年6月30日。
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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	85,555,072.86	93.56
	其中:股票	85,555,072.86	93.56
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	5,824,415.04	6.37
8	其他资产	65,884.42	0.07
9	合计	91,445,372.32	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合
2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
2.1.1 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(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,122,934.16	3.43
C	制造业	30,325,287.34	33.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,165,901.00	2.38
E	建筑业	7,187,259.20	7.90
F	批发和零售业	731,821.00	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	4,850,047.32	5.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,822,517.00	3.10
J	金融业	16,546,502.38	18.20
K	房地产业	5,306,303.67	5.84
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	73,058,573.07	80.34

2.1.2 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(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	167,688.00	0.18
B	采矿业	383,415.00	0.42
C	制造业	8,330,061.82	9.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	176,615.85	0.19
E	建筑业	799,637.98	0.88
F	批发和零售业	960,153.00	1.06
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	1,516,726.00	1.67
J	金融业	-	-
K	房地产业	80,976.00	0.09
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	81,226.14	0.09
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	12,496,499.79	13.74

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。
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
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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600332	白云山	71,800	2,731,990.00	3.00
2	000338	潍柴动力	296,200	2,591,750.00	2.85
3	600104	上汽集团	72,100	2,522,779.00	2.77
4	000651	格力电器	52,900	2,494,235.00	2.74
5	601006	大秦铁路	282,892	2,322,543.32	2.55
6	601390	中国中铁	309,400	2,311,218.00	2.54
7	600741	华域汽车	96,600	2,291,352.00	2.52
8	601288	农业银行	658,500	2,265,240.00	2.49
9	601398	工商银行	422,700	2,248,764.00	2.47
10	002146	荣盛发展	250,479	2,186,681.67	2.40

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	期末公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	002373	千方科技	108,200	1,412,010.00	1.55
2	600216	浙江医药	101,000	1,289,770.00	1.42
3	600516	方大炭素	51,100	1,245,818.00	1.37
4	002626	金达威	39,000	676,650.00	0.74
5	600569	安阳钢铁	165,500	652,070.00	0.72

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 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。
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。
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。
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。
9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
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。
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。
10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
10.1 本期国债期货投资政策
本基金暂不投资国债期货。
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。
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。
11 投资组合报告附注
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。
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。
11.3 其他资产构成
单位:人民币元

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

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。
11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
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
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（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

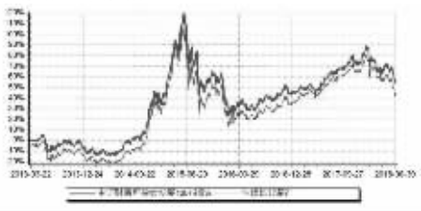
11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。
11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。
十二、基金的业绩
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
（一）基金净值表现
1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
中证财通可持续发展100指数A

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
2013年03月22日-2013年12月31日	-5.50%	1.06%	-12.82%	1.23%	7.32%	-0.17%
2014年1月1日-2014年12月31日	48.99%	1.08%	53.00%	1.14%	-4.01%	-0.06%
2015年01月01日-2015年12月31日	11.72%	2.16%	9.19%	2.41%	2.53%	-0.25%
2016年01月01日-2016年12月31日	-8.52%	1.36%	-7.87%	1.41%	-0.65%	-0.05%
2017年01月01日-2017年12月31日	20.77%	0.51%	24.14%	0.52%	-3.37%	-0.01%
2018年01月01日-2018年6月30日	-9.19%	1.08%	-12.85%	1.06%	3.66%	0.02%
自基金合同生效起至今（2013年03月22日-2018年6月30日）	57.82%	1.34%	45.16%	1.46%	12.66%	-0.12%

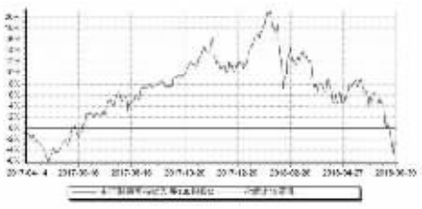
中证财通可持续发展100指数C

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
2017年04月14日-2017年12月31日	0.00%	0.00%	11.88%	0.54%	-11.88%	-0.54%
2018年01月01日-2018年6月30日	0.00%	0.00%	-12.85%	1.06%	12.85%	-1.06%
自基金合同生效起至今（2017年04月14日-2018年6月30日）	0.00%	0.00%	-2.49%	0.85%	2.49%	-0.85%

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报告期自2017年4月14日起至6月30日，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。
（二）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
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(ECPI ESG)指数增强型证券投资基金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；截至本报告期末按公允价值计算，本报告期内未有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；
十三、基金费用与税收
（一）基金费用的种类
1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、基金的销售服务费；
4、基金的标的指数使用费；
5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
7、基金份额持有人大会费用；
8、基金的证券交易费用；
9、基金的银行汇划费用；
10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。
本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。
（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1、基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×1.00%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。
2、基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H＝E×0.15%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。
3、基金的销售服务费
销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额销售服务费年费率为0.4%。
本基金C类基金份额销售服务费计提的计算公式如下：
H＝E×0.4%÷当年天数
H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费
E为前一日C类基金份额的基金资产净值
C类基金份额的销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。
4、本基金的标的指数许可使用费
本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付标的指数许可使用费。
通常情况下，标的指数许可使用费按前一日的基金资产净值的0.016%的年费率计提。计算方法一般如下：
H＝E×0.016%÷当年天数
H为每日应计提的指数许可使用费
E为前一日的基金资产净值
指数许可使用费的收取下限为每季度人民币5万元。
指数许可使用费日基金合同生效日起每日计提，按季支付。由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于次季初十个工作日前从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。
上述一、基金费用的种类中第5－10项费用，根据有关法律法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。
（三）不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用：
1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
（四）费用调整
基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。
调高基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。
基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。
（五）基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。
十四、对招募说明书更新部分的说明
1、“重要提示”部分
（1）更新了本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现截止日。
2、“二、释义”部分
（1）更新了流动性风险管理规定；
（2）更新了流动性受限资产。
3、“三、基金管理人”部分
（1）更新了主要人员情况。
4、“四、基金托管人”部分
（1）更新了基金托管人情况；
5、“五、相关服务机构”部分
（1）更新了代销机构方面信息。
6、“八、基金份额的申购与赎回”部分
（1）更新了申购和赎回的数额限制；
（2）更新了申购费用和赎回费用；
（3）更新了拒绝或暂停申购的情形及处理方式；
（4）更新了暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式；
（5）更新了巨额赎回的情形及处理方式。
7、“九、基金的投资”部分
（1）更新了投资范围；
（2）更新了投资限制；
（3）更新了基金投资组合报告，报告所载数据截至2018年6月30日。
8、“十、基金的业绩”部分
（1）更新了基金的业绩。
9、“十二、基金资产估值”部分
（1）更新了暂停估值的情形。
10、“十六、基金的信息披露”部分
（1）更新了公开披露的基金信息。
11、“二十、基金托管协议的内容摘要”部分
（1）更新了托管协议的当事人；
（2）更新了基金托管人对基金管理人的业务监督和核查。
12、“二十三、其他应披露事项”部分
（1）更新了2018年1月1日至2018年9月18日期间涉及本基金的相关公告。

财通基金管理有限公司
二〇一八年十一月三日

证券代码:603667　证券简称:五洲新春　公告编号:2018-108

浙江五洲新春集团股份有限公司关于回购公司股份的进展公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

浙江五洲新春集团股份有限（以下简称“公司”）于2018年10月15日召开了2018年第一次临时股东大会，逐项审议并通过了《关于以集中竞价交易方式回购股份预案的议案》及相关议案，并于10月23日披露了本次回购报告书。详细内容见公司在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）披露的公告（公告编号:2018-095、2018-101）。

根据《上市公司回购社会公众股份管理办法（试行）》、《上海证券交易所上市公司以集中竞价交易方式回购股份的业务指引（2013年修订）》等相关规定，上市公司应当在每个月前3个交易日内，公告截止上月末的回购进展情况。

截止2018年10月31日，公司通过集中竞价方式回购股份数量为1,690,038股，占公司目前总股本的比例为0.64%。成交的最低价格为7.88元/股，成交的最高价格为8.35元/股，支付的总金额为13,748,872.56元（不含佣金、过户费等交易费用），本月回购符合公司回购方案的要求。

公司后续将根据回购股份进展情况及时履行信息披露义务，敬请投资者理性投资，注意投资风险。

特此公告。

浙江五洲新春集团股份有限公司董事会
2018年11月3日

证券代码:603667　证券简称:五洲新春　公告编号:2018-109

浙江五洲新春集团股份有限公司关于发行股份及支付现金购买资产并配套募集资金暨关联交易之标的资产过户完成的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

浙江五洲新春集团股份有限公司（以下简称“公司”）于2018年10月15日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）出具的《关于核准浙江五洲新春集团股份有限公司向浙江五洲新春集团控股有限公司等发行股份购买资产并募集配套资金的批复》（证监许可〔2018〕1607号），具体内容见公司于10月16日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）披露的公告（公告编号:2018-097）。

截止本公告日，本次发行股份及支付现金购买资产并配套募集资金暨关联交易之标的资产已过户完成，具体情况如下:

一、本次交易标的资产过户情况

2018年10月31日，本次交易标的浙江新龙实业有限公司（以下简称“新龙实业”）100%股权已过户至公司名下，相关工商变更登记手续已经办理完毕。新龙实业已经取得新昌县市场监督管理局换发的《营业执照》。至此，标的资产过户手续已办理完成，公司已持有新龙实业100%股权。

二、后续事项