

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 2024 年中期报告

2024 年 06 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

送出日期:2024 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2024年8月30日复核了本报告中的财务指标、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，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。

本报告期自2024年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

|   |    |
|---|----|
| §1 重要提示及目录                              | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| 1.2 目录                                  | 3  |
| §2 基金简介                                 | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式                              | 7  |
| 2.5 其他相关资料                              | 7  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现                        | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现                              | 8  |
| §4 管理人报告                                | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 14 |
| §5 托管人报告                                | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）                      | 15 |
| 6.1 资产负债表                               | 15 |
| 6.2 利润表                                 | 16 |
| 6.3 净资产变动表                              | 18 |
| 6.4 报表附注                                | 20 |
| §7 投资组合报告                               | 41 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 41 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 41 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 43 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 47 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 51 |
| 7.6 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      | 51 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 51 |
| 7.8 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贵金属投资明细   | 51 |

|  |    |
|--|----|
| 7.9 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 ..... | 51 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                | 51 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 51 |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                      | 52 |
| §8 基金份额持有人信息 .....                       | 53 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 53 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 53 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....   | 54 |
| §9 开放式基金份额变动 .....                       | 54 |
| §10 重大事件揭示 .....                         | 55 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 55 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....   | 55 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 55 |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 55 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 55 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....      | 55 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 55 |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 56 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 58 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 ..... | 58 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 58 |
| §12 备查文件目录 .....                         | 58 |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 59 |
| 12.2 存放地点 .....                          | 59 |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 59 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                                     |                 |
|-----------------|-------------------------------------|-----------------|
| 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            | 财通中证ESG100指数增强                      |                 |
| 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                         |                 |
| 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                          |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 35,643,695.78份                      |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                                 |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 财通中证ESG100指数增强A                     | 财通中证ESG100指数增强C |
| 下属分级基金场内简称      | -                                   | -               |
| 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 | 35,643,695.78份                      | 0.00份           |

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)本基金自2021年8月19日起本基金的基金简称由“中证财通可持续发展100指数”变更为“财通中证ESG100指数增强”，A类基金份额简称由“中证财通可持续发展100指数A”变更为“财通中证ESG100指数增强A”，C类基金份额简称由“中证财通可持续发展100指数C”变更为“财通中证ESG100指数增强C”，基金代码和其他信息均保持不变。

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 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%。 |  |
| 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。  |  |
| 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。  |  |
| 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。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人              | 基金托管人                 |
|---------|------|--------------------|-----------------------|
| 名称      |      | 财通基金管理有限公司         | 上海银行股份有限公司            |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 方斌                 | 周直毅                   |
|         | 联系电话 | 021-20537888       | 021-68475608          |
|         | 电子邮箱 | service@ctfund.com | custody@bosc.cn       |
| 客户服务电话  |      | 400-820-9888       | 95594                 |
| 传真      |      | 021-68888169       | 021-68476901          |
| 注册地址    |      | 上海市虹口区吴淞路619号505室  | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号 |
| 办公地址    |      | 上海市浦东新区银城中路68      | 中国（上海）自由贸易试验区         |

|       |               |             |
|-------|---------------|-------------|
|       | 号时代金融中心43/45楼 | 银城中路168号27层 |
| 邮政编码  | 200120        | 200120      |
| 法定代表人 | 吴林惠           | 金煜          |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                 |
|---------------------|-----------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券日报            |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.ctfund.com  |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人办公地址 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                       |
|--------|------------|----------------------------|
| 注册登记机构 | 财通基金管理有限公司 | 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43/45楼 |

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期<br>(2024年01月01日-2024年06月30日) |                 |
|---------------|----------------------------------|-----------------|
|               | 财通中证ESG100指数增强A                  | 财通中证ESG100指数增强C |
| 本期已实现收益       | -89,432.98                       | -               |
| 本期利润          | 2,156,046.46                     | -               |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0583                           | -               |
| 本期加权平均净值利润率   | 3.37%                            | -               |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.23%                            | -               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末<br>(2024年06月30日)            |                 |

|                     |                       |        |
|---------------------|-----------------------|--------|
| 期末可供分配利润            | 26,135,606.16         | -      |
| 期末可供分配基金份额利润        | 0.7332                | -      |
| 期末基金资产净值            | 61,779,301.94         | -      |
| 期末基金份额净值            | 1.7332                | 1.0000 |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b> | 报告期末<br>(2024年06月30日) |        |
| 基金份额累计净值增长率         | 138.96%               | -      |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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)期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

(4)截至报告期末，本基金C类基金份额总额为0，C类基金份额净值为1.0000元。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

财通中证ESG100指数增强A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | -2.41%   | 0.49%       | -3.72%     | 0.56%         | 1.31%  | -0.07% |
| 过去三个月      | -0.53%   | 0.73%       | -2.33%     | 0.79%         | 1.80%  | -0.06% |
| 过去六个月      | 3.23%    | 0.85%       | 0.64%      | 0.91%         | 2.59%  | -0.06% |
| 过去一年       | -4.73%   | 0.79%       | -8.60%     | 0.85%         | 3.87%  | -0.06% |
| 过去三年       | -14.18%  | 0.97%       | -21.18%    | 0.97%         | 7.00%  | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | 138.96%  | 1.22%       | 51.11%     | 1.29%         | 87.85% | -0.07% |

财通中证ESG100指数增强C



| 阶段           | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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    |
|--------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月        | 0.00%    | 0.00%       | -3.72%     | 0.56%         | 3.72%  | -0.56% |
| 过去三个月        | 0.00%    | 0.00%       | -2.33%     | 0.79%         | 2.33%  | -0.79% |
| 过去六个月        | 0.00%    | 0.00%       | 0.64%      | 0.91%         | -0.64% | -0.91% |
| 过去一年         | 0.00%    | 0.00%       | -8.60%     | 0.85%         | 8.60%  | -0.85% |
| 过去三年         | 0.00%    | 0.00%       | -21.18%    | 0.97%         | 21.18% | -0.97% |
| 自增加C类基金份额起至今 | 0.00%    | 0.00%       | 1.51%      | 1.07%         | -1.51% | -1.07% |

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)截至报告期末，本基金C类基金份额总额为0，C类基金份额净值为1.0000元。

### 3.2.2 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





- 注：(1)本基金合同生效日为2013年3月22日；  
 (2)本基金建仓期为基金合同生效起6个月，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；  
 (4)截至报告期末，本基金C类基金份额总额为0，C类基金份额净值为1.0000元。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

财通基金管理有限公司（下称“财通基金”）经中国证监会批准，于2011年6月正式成立。目前公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、QDII、受托管理保险资金投资管理等业务资格。公司股东为财通证券股份有限公司、杭州市实业投资集团有限公司和浙江亨通控股股份有限公司，注册资本2亿元人民币，注册地上海。成立近13年来，公司收获了“三大报”权威奖项（金牛奖+金基金奖+明星基金奖），先后荣获110余项业内权威大奖。

截至2024年6月末，财通基金合计管理规模约1,267.14亿元，其中，公募基金管理规模约921.26亿元。公司以打造“特色鲜明、多元发展、客户信赖”的一流资产管理公司为企业愿景，坚持多元化业务布局，旗下公募基金覆盖股票、混合、债券、指数、货币等完整产品线，可满足不同类型客户的多元化需求。同时公司在专户业务中勇于突破，不断探索定增+、固收+、量化+等特色领域，努力以专业创造价值。

财通基金始终恪守“敬畏、感恩、专业、责任”的核心价值观，坚信投研是核心竞争力，为客户创造收益才是硬道理。公司以资产管理为本源，坚守初心、苦练内功，配备了一支资深投研专家团队，纵深一级半、二级市场，持续为投资者创造价值。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|----------|-----------------|------|--------|---|
|     |          | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 顾弘原 | 本基金的基金经理 | 2023-01-16      | -    | 7年     | 伦敦政治经济学院统计学硕士。历任香港伟享证券有限公司分析师。2017年2月加入财通基金管理有限公司，曾任量化投资部助理研究员、研究员，现任量化投资部基金经理。 |

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”分别指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法律法规及行业协会的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 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手备选库，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资对象备选库和交易对手备选库，进而根据投资授权构建具体的投资组合。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管理办法》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

本投资组合为指数增强型开放式基金。本报告期内，本投资组合的主动型投资部分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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金组合采用类行业中性配置，力争控制行业暴露在较低范围之内，同时控制组合相对市场主流风格如大小盘、价值、成长等的暴露，采用量化模型在行业内优选个股，分散持仓，力争获得相对业绩基准的长期的超额收益，此外积极参与新股申购，进一步增强组合相对于业绩基准的阿尔法。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，财通中证ESG100指数增强A基金份额净值为1.7332元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.23%，同期业绩比较基准收益率为0.64%；截至报告期末，财通中证ESG100指数增强C基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.00%，同期业绩比较基准收益率为0.64%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾2024年上半年，国内宏观经济依旧维持弱复苏态势，但动能有所衰弱。3月份开始，信贷脉冲持续走弱，背后一方面是私人部门需求疲软，个人和企业信贷乏力。另一方面，今年财政节奏偏缓，实物工作开展进度偏慢。除此之外，M1和M2剪刀差持续收敛，其中有取消“手工补息”监管的影响，但也有实体微观活力不足的隐忧。从PMI来看，信贷下滑的结果是5、6月份连续两个月略弱于预期的经济扩张幅度。“供强需弱”格局下，今年二季度，国内CPI、PPI整体小幅回升，但“回升”斜率并不陡峭，企业盈利改善较难“一蹴而就”。

海外方面，今年以来市场反复博弈美联储是否会提前降息，但目前美国经济数据依旧不弱，6月份议息会议基本确认美联储将继续维持“Higher for Longer”的货币政策导向。与此同时，近期美国大选风险逐渐进入视野，我们认为这使得短期内美债利率或将继续维持高位。对于国内而言，货币政策在需求走弱的环境下，虽有加码必要，但考虑到内外息差下汇率承压，加之“资金防空转”导向下，我们认为货币政策上进行价格型调控的空间相对有限，结构性货币政策在未来一段时间内或将仍是调控主线。

经济目前仍在持续复苏的脉络上，展望下半年宏观基本面，市场风险与机遇并存。机遇方面，国内政策层面大概率不会“大水漫灌”，而是继续以“固本培元”稳增长为主。我们认为可能的主线有两条：一是专项债发行节奏能否提速，进而形成有效实物工作量，二是“两会”提出的“新质生产力”相关扶持政策辐射范围能否进一步扩增。除此之外，如果海外增长超预期，或美联储超预期提前降息，海外金融条件将有望进一步放松，从而为国内货币政策提供更多空间。风险方面，下半年海外经济增速的放缓和地缘政治摩擦或将通过出口链给国内增长带来一定压力。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》《关于固定收益品种的估值处理标准》《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》《资产管理产品相关会计处理规定》等法律法规、自律规则，公司设立估值委员会并制定估值委员会议事规则。

估值委员会成员由常设委员和非常设委员组成。常设委员为委员会会议必然参会人员，非常设委员根据审议议题邀请参会。常设委员包括总经理、督察长、基金清算部门分管领导、风险管理部负责人、法律合规部负责人、基金清算部负责人；非常设委员为会议议题涉及的投资组合经理和研究人员及其所在部门负责人、分管领导，在每次会议召集时确定。估值委员会成员均具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用、风险管理等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力。如果基金经理认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管人同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序、确定调整/暂停估值方案，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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，本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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、托管协议的规定，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。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2024年06月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 货币资金       | 6.4.7.1 | 4,526,221.12       | 4,934,571.67        |
| 结算备付金      |         | -                  | -                   |
| 存出保证金      |         | -                  | -                   |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 57,626,962.23      | 62,660,710.89       |
| 其中：股票投资    |         | 57,626,962.23      | 62,660,710.89       |
| 基金投资       |         | -                  | -                   |
| 债券投资       |         | -                  | -                   |
| 资产支持证券投资   |         | -                  | -                   |
| 贵金属投资      |         | -                  | -                   |
| 其他投资       |         | -                  | -                   |
| 衍生金融资产     | 6.4.7.3 | -                  | -                   |
| 买入返售金融资产   | 6.4.7.4 | -                  | -                   |
| 应收清算款      |         | -                  | -                   |
| 应收股利       |         | -                  | -                   |
| 应收申购款      |         | 214,934.89         | 23,680.99           |
| 递延所得税资产    |         | -                  | -                   |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                          | -                           |
| 资产总计          |            | 62,368,118.24              | 67,618,963.55               |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2023年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                            |                             |
| 短期借款          |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债       |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                          | -                           |
| 应付清算款         |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款         |            | 8,824.30                   | 42,525.38                   |
| 应付管理人报酬       |            | 51,055.91                  | 56,434.68                   |
| 应付托管费         |            | 7,658.38                   | 8,465.21                    |
| 应付销售服务费       |            | -                          | -                           |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |
| 应交税费          |            | -                          | -                           |
| 应付利润          |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                          | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.6    | 521,277.71                 | 578,130.81                  |
| 负债合计          |            | 588,816.30                 | 685,556.08                  |
| <b>净资产：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 35,643,695.78              | 39,866,628.33               |
| 未分配利润         | 6.4.7.8    | 26,135,606.16              | 27,066,779.14               |
| 净资产合计         |            | 61,779,301.94              | 66,933,407.47               |
| 负债和净资产总计      |            | 62,368,118.24              | 67,618,963.55               |

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额总额35,643,695.78份。其中A类基金份额净值1.7332元，份额总额35,643,695.78份；C类基金份额净值1.0000元，份额总额0.00份。

## 6.2 利润表

会计主体：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：2024年01月01日至2024年06月30日



单位：人民币元

| 项目                        | 附注号        | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年06月30日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至202<br>3年06月30日 |
|---------------------------|------------|-----------------------------------|--|
| <b>一、营业总收入</b>            |            | 2,668,868.55                      | 10,963,842.52                          |
| 1.利息收入                    |            | 10,103.82                         | 16,065.02                              |
| 其中：存款利息收入                 | 6.4.7.9    | 10,103.82                         | 16,065.02                              |
| 债券利息收入                    |            | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券利息<br>收入            |            | -                                 | -                                      |
| 买入返售金融资产<br>收入            |            | -                                 | -                                      |
| 其他利息收入                    |            | -                                 | -                                      |
| 2.投资收益（损失以“-”填<br>列）      |            | 402,096.74                        | -6,431,764.61                          |
| 其中：股票投资收益                 | 6.4.7.10   | -317,041.32                       | -6,778,612.90                          |
| 基金投资收益                    |            | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益                    | 6.4.7.11   | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券投资<br>收益            |            | -                                 | -                                      |
| 贵金属投资收益                   |            | -                                 | -                                      |
| 衍生工具收益                    | 6.4.7.12   | -                                 | -                                      |
| 股利收益                      | 6.4.7.13   | 719,138.06                        | 346,848.29                             |
| 其他投资收益                    |            | -                                 | -                                      |
| 3.公允价值变动收益（损失<br>以“-”号填列） | 6.4.7.14   | 2,245,479.44                      | 17,371,965.96                          |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号<br>填列）     |            | -                                 | -                                      |
| 5.其他收入（损失以“-”号<br>填列）     | 6.4.7.15   | 11,188.55                         | 7,576.15                               |
| <b>减：二、营业总支出</b>          |            | 512,822.09                        | 811,136.85                             |
| 1.管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 318,685.12                        | 544,949.76                             |

|                     |            |              |               |
|---------------------|------------|--------------|---------------|
| 2.托管费               | 6.4.10.2.2 | 47,802.77    | 81,742.48     |
| 3.销售服务费             | 6.4.10.2.3 | -            | -             |
| 4.投资顾问费             |            | -            | -             |
| 5.利息支出              |            | -            | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | -            | -             |
| 6.信用减值损失            | 6.4.7.16   | -            | -             |
| 7.税金及附加             |            | -            | -             |
| 8.其他费用              | 6.4.7.17   | 146,334.20   | 184,444.61    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 2,156,046.46 | 10,152,705.67 |
| 减：所得税费用             |            | -            | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 2,156,046.46 | 10,152,705.67 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |            | -            | -             |
| 六、综合收益总额            |            | 2,156,046.46 | 10,152,705.67 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：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：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

| 项目                   | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |               |               |
|----------------------|-------------------------------|---------------|---------------|
|                      | 实收基金                          | 未分配利润         | 净资产合计         |
| 一、上期期末净资产            | 39,866,628.33                 | 27,066,779.14 | 66,933,407.47 |
| 二、本期期初净资产            | 39,866,628.33                 | 27,066,779.14 | 66,933,407.47 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -4,222,932.55                 | -931,172.98   | -5,154,105.53 |

|  |                                    |                |                 |
|--|------------------------------------|----------------|-----------------|
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | 2,156,046.46   | 2,156,046.46    |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -4,222,932.55                      | -3,087,219.44  | -7,310,151.99   |
| 其中：1.基金申购款                               | 2,543,833.54                       | 1,843,400.78   | 4,387,234.32    |
| 2.基金赎回款                                  | -6,766,766.09                      | -4,930,620.22  | -11,697,386.31  |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                                  | -              | -               |
| 四、本期期末净资产                                | 35,643,695.78                      | 26,135,606.16  | 61,779,301.94   |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |                |                 |
|  | 实收基金                               | 未分配利润          | 净资产合计           |
| 一、上期期末净资产                                | 101,310,033.87                     | 75,171,071.89  | 176,481,105.76  |
| 二、本期期初净资产                                | 101,310,033.87                     | 75,171,071.89  | 176,481,105.76  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -62,014,288.90                     | -42,977,693.79 | -104,991,982.69 |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | 10,152,705.67  | 10,152,705.67   |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -62,014,288.90                     | -53,130,399.46 | -115,144,688.36 |

|  |                |                |                 |
|--|----------------|----------------|-----------------|
| 列)                                       |                |                |                 |
| 其中：1.基金申购款                               | 6,729,798.70   | 5,788,382.86   | 12,518,181.56   |
| 2.基金赎回款                                  | -68,744,087.60 | -58,918,782.32 | -127,662,869.92 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -              | -              | -               |
| 四、本期期末净资产                                | 39,295,744.97  | 32,193,378.10  | 71,489,123.07   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

徐春庭

刘为臻

刘为臻

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]100号文《关于核准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募集的批复》核准募集，由基金管理人财通基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2013年3月22日生效，首次设立募集规模为247,395,794.87份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为财通基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

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、存托凭证）、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）。

基金的投资组合比例为：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。

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%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2024年6月30日的财务状况、自2024年1月1日起至2024年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关

于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a)资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

b)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

d)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

e)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024年06月30日 |
|----|--------------------|
|----|--------------------|

|              |              |
|--------------|--------------|
| 活期存款         | 867,296.79   |
| 等于：本金        | 867,144.68   |
| 加：应计利息       | 152.11       |
| 减：坏账准备       | -            |
| 定期存款         | -            |
| 等于：本金        | -            |
| 加：应计利息       | -            |
| 减：坏账准备       | -            |
| 其中：存款期限1个月以内 | -            |
| 存款期限1-3个月    | -            |
| 存款期限3个月以上    | -            |
| 其他存款         | 3,658,924.33 |
| 等于：本金        | 3,658,559.21 |
| 加：应计利息       | 365.12       |
| 减：坏账准备       | -            |
| 合计           | 4,526,221.12 |

注：其他存款期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2024年06月30日 |      |               |             |
|---------------|--------------------|------|---------------|-------------|
|               | 成本                 | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动      |
| 股票            | 58,533,063.41      | -    | 57,626,962.23 | -906,101.18 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                  | -    | -             | -           |
| 债券            | 交易所市场              | -    | -             | -           |
|               | 银行间市场              | -    | -             | -           |
|               | 合计                 | -    | -             | -           |
| 资产支持证券        | -                  | -    | -             | -           |
| 基金            | -                  | -    | -             | -           |

|    |               |   |               |             |
|----|---------------|---|---------------|-------------|
| 其他 | -             | - | -             | -           |
| 合计 | 58,533,063.41 | - | 57,626,962.23 | -906,101.18 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | 31.51              |
| 应付证券出借违约金   | -                  |
| 应付交易费用      | -                  |
| 其中：交易所市场    | -                  |
| 银行间市场       | -                  |
| 应付利息        | -                  |
| 预提费用        | 521,246.20         |
| 合计          | 521,277.71         |

### 6.4.7.7 实收基金

#### 6.4.7.7.1 财通中证ESG100指数增强A

金额单位：人民币元



| 项目<br>(财通中证ESG100指数增强<br>A) | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |               |
|-----------------------------|-------------------------------|---------------|
|                             | 基金份额（份）                       | 账面金额          |
| 上年度末                        | 39,866,628.33                 | 39,866,628.33 |
| 本期申购                        | 2,543,833.54                  | 2,543,833.54  |
| 本期赎回（以“-”号填列）               | -6,766,766.09                 | -6,766,766.09 |
| 本期末                         | 35,643,695.78                 | 35,643,695.78 |

**6.4.7.7.2 财通中证ESG100指数增强C**

金额单位：人民币元

| 项目<br>(财通中证ESG100指数增强<br>C) | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |      |
|-----------------------------|-------------------------------|------|
|                             | 基金份额（份）                       | 账面金额 |
| 上年度末                        | -                             | -    |
| 本期申购                        | -                             | -    |
| 本期赎回（以“-”号填列）               | -                             | -    |
| 本期末                         | -                             | -    |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**6.4.7.8 未分配利润**

**6.4.7.8.1 财通中证ESG100指数增强A**

单位：人民币元

| 项目<br>(财通中证ESG100指<br>数增强A) | 已实现部分         | 未实现部分          | 未分配利润合计       |
|-----------------------------|---------------|----------------|---------------|
| 上年度末                        | 46,364,078.94 | -19,297,299.80 | 27,066,779.14 |
| 本期期初                        | 46,364,078.94 | -19,297,299.80 | 27,066,779.14 |
| 本期利润                        | -89,432.98    | 2,245,479.44   | 2,156,046.46  |
| 本期基金份额交易产<br>生的变动数          | -4,685,288.21 | 1,598,068.77   | -3,087,219.44 |
| 其中：基金申购款                    | 2,884,492.52  | -1,041,091.74  | 1,843,400.78  |
| 基金赎回款                       | -7,569,780.73 | 2,639,160.51   | -4,930,620.22 |

|         |               |                |               |
|---------|---------------|----------------|---------------|
| 本期已分配利润 | -             | -              | -             |
| 本期末     | 41,589,357.75 | -15,453,751.59 | 26,135,606.16 |

#### 6.4.7.8.2 财通中证ESG100指数增强C

单位：人民币元

| 项目<br>(财通中证ESG100指<br>数增强C) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-----------------------------|-------|-------|---------|
| 上年度末                        | -     | -     | -       |
| 本期期初                        | -     | -     | -       |
| 本期利润                        | -     | -     | -       |
| 本期基金份额交易产<br>生的变动数          | -     | -     | -       |
| 其中：基金申购款                    | -     | -     | -       |
| 基金赎回款                       | -     | -     | -       |
| 本期已分配利润                     | -     | -     | -       |
| 本期末                         | -     | -     | -       |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 2,976.48                      |
| 定期存款利息收入  | -                             |
| 其他存款利息收入  | 7,127.34                      |
| 结算备付金利息收入 | -                             |
| 其他        | -                             |
| 合计        | 10,103.82                     |

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期                      |
|------------|-------------------------|
|            | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 179,571,715.30          |
| 减：卖出股票成本总额 | 179,638,075.99          |
| 减：交易费用     | 250,680.63              |
| 买卖股票差价收入   | -317,041.32             |

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期未有债券投资收益。

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期未有债券买卖差价收入。

##### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未有债券赎回差价收入。

##### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未有债券申购差价收入。

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

##### 6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

#### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期                      |
|---------------|-------------------------|
|               | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 719,138.06              |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                       |
| 基金投资产生的股利收益   | -                       |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 719,138.06 |
|----|------------|

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 1.交易性金融资产              | 2,245,479.44                  |
| ——股票投资                 | 2,245,479.44                  |
| ——债券投资                 | -                             |
| ——资产支持证券投资             | -                             |
| ——贵金属投资                | -                             |
| ——其他                   | -                             |
| 2.衍生工具                 | -                             |
| ——权证投资                 | -                             |
| 3.其他                   | -                             |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                             |
| 合计                     | 2,245,479.44                  |

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |
|---------|-------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 10,511.42                     |
| 转换费收入   | 677.13                        |
| 合计      | 11,188.55                     |

#### 6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                      |
|---------|-------------------------|
|         | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 审计费用    | 6,464.64                |
| 信息披露费   | 39,781.56               |
| 证券出借违约金 | -                       |
| 汇划手续费   | 88.00                   |
| 指数使用费   | 100,000.00              |
| 合计      | 146,334.20              |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称              | 与本基金的关系             |
|--------------------|---------------------|
| 财通基金管理有限公司（“财通基金”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 财通证券股份有限公司（“财通证券”） | 基金管理人的股东、基金代销机构     |
| 上海银行股份有限公司（“上海银行”） | 基金托管人、基金代销机构        |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------|----|---------|
|------|----|---------|

| 称    | 2024年01月01日至2024年06月30日 |              | 2023年01月01日至2023年06月30日 |              |
|------|-------------------------|--------------|-------------------------|--------------|
|      | 成交金额                    | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额                    | 占当期股票成交总额的比例 |
| 财通证券 | 351,930,563.19          | 100.00%      | 691,691,940.70          | 100.00%      |

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日      |            |          |              |
|-------|------------------------------------|------------|----------|--------------|
|       | 当期佣金                               | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 财通证券  | 138,319.43                         | 100.00%    | -        | -            |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |            |          |              |
|       | 当期佣金                               | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 财通证券  | 146,673.16                         | 100.00%    | -        | -            |

注：(1)上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示；

(2)本基金管理人在《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称“佣金新规”）施行日前已与相关券商按佣金新规的要求更新相关服务协议，协议生效日前本基金管理人在租用证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还获得证券研究综合服务，自协议生效日起，本基金管理人不再获得证券研究综合服务。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2024年01月01日至20<br>24年06月30日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至20<br>23年06月30日 |
|------------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 318,685.12                        | 544,949.76                             |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 85,823.63                         | 93,093.01                              |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 232,861.49                        | 451,856.75                             |

注：(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

(2)基金管理费计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024年01月01日至2024<br>年06月30日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023<br>年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 47,802.77                         | 81,742.48                              |

注：(1)支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

(2)基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间均无需要支付给关联方的销售服务费。

注：(1)本基金A类基金份额不收取销售服务费；

(2)本基金C类基金份额销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值的0.40%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

(3)本基金C类基金份额销售服务费的计算公式为：每日应计提的销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**

**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**  
无。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**  
无。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |          | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |           |
|-------|-------------------------------|----------|------------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                          | 当期利息收入   | 期末余额                               | 当期利息收入    |
| 上海银行  | 867,296.79                    | 2,976.48 | 1,723,802.65                       | 4,399.29  |
| 财通证券  | 3,658,924.33                  | 7,127.34 | 3,559,109.68                       | 11,605.73 |

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

**6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**



本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项的说明。

#### **6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用**

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

#### **6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### **6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券**

##### **6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

##### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

###### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

###### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

##### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

无。

#### **6.4.13 金融工具风险及管理**

##### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的管理人进行风险管理的主要目标是加强对投资风险的控制，保证基金资产的安全，维护基金份额持有人的利益；同时，提升基金投资组合的风险调整后收益水平，将以上各种风险控制在限定的范围之内，在基金的风险和收益之间取得最佳的平衡，实现“风险和收益相匹配”的投资目标，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会下设合规控制委员会，负责对公司风险管理战略和政策、

内部控制及风险控制基本制度进行审定，对基本制度的执行情况、关联交易的合法合规性等进行监督和检查。董事会聘任督察长，负责公司及其基金运作的监察稽核工作。公司经营管理层负责公司日常经营管理中的风险控制工作，经营管理层下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。公司各业务部门根据具体情况制定本部门的作业流程及风险控制制度，加强对风险的控制，作为一线责任人，将风险控制在最小范围内。同时，公司设独立的法律合规部和风险管理部，两者依各自职能对公司运作各环节的各类风险进行监控。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对各类投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估，建立相应的分级别的交易对手库，并分别限定交易额度，同时采取一定的风险缓释措施。本基金的银行存款存放在本基金的托管人上海银行股份有限公司，还有部分存款存放在开立于本基金的结算机构财通证券的证券账户内，按银行同业利率计息，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

##### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，并对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不超过7个工作日可变现资产的可变现价值，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款，结算备付金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----|-------|-------|--------|------|------|-----|----|
|     |       |       |        |      |      |     |    |

|             |              |   |   |   |   |               |               |
|-------------|--------------|---|---|---|---|---------------|---------------|
| 2024年06月30日 |              |   |   |   |   |               |               |
| 资产          |              |   |   |   |   |               |               |
| 货币资金        | 4,526,221.12 | - | - | - | - | -             | 4,526,221.12  |
| 交易性金融资产     | -            | - | - | - | - | 57,626,962.23 | 57,626,962.23 |
| 应收申购款       | -            | - | - | - | - | 214,934.89    | 214,934.89    |
| 资产总计        | 4,526,221.12 | - | - | - | - | 57,841,897.12 | 62,368,118.24 |
| 负债          |              |   |   |   |   |               |               |
| 应付赎回款       | -            | - | - | - | - | 8,824.30      | 8,824.30      |
| 应付管理人报酬     | -            | - | - | - | - | 51,055.91     | 51,055.91     |
| 应付托管费       | -            | - | - | - | - | 7,658.38      | 7,658.38      |
| 其他负债        | -            | - | - | - | - | 521,277.71    | 521,277.71    |
| 负债总计        | -            | - | - | - | - | 588,816.30    | 588,816.30    |
| 利率敏感        | 4,526,221.12 | - | - | - | - | 57,253,080.82 | 61,779,301.94 |

| 度缺口                 |              |       |        |      |      |               |               |
|---------------------|--------------|-------|--------|------|------|---------------|---------------|
| 上年度末<br>2023年12月31日 | 1个月以内        | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计            |
| 资产                  |              |       |        |      |      |               |               |
| 货币资金                | 4,934,571.67 | -     | -      | -    | -    | -             | 4,934,571.67  |
| 交易性金融资产             | -            | -     | -      | -    | -    | 62,660,710.89 | 62,660,710.89 |
| 应收申购款               | -            | -     | -      | -    | -    | 23,680.99     | 23,680.99     |
| 资产总计                | 4,934,571.67 | -     | -      | -    | -    | 62,684,391.88 | 67,618,963.55 |
| 负债                  |              |       |        |      |      |               |               |
| 应付赎回款               | -            | -     | -      | -    | -    | 42,525.38     | 42,525.38     |
| 应付管理人报酬             | -            | -     | -      | -    | -    | 56,434.68     | 56,434.68     |
| 应付托管费               | -            | -     | -      | -    | -    | 8,465.21      | 8,465.21      |
| 其他负债                | -            | -     | -      | -    | -    | 578,130.81    | 578,130.81    |

|         |              |   |   |   |   |               |               |
|---------|--------------|---|---|---|---|---------------|---------------|
| 负债总计    | -            | - | - | - | - | 685,556.08    | 685,556.08    |
| 利率敏感度缺口 | 4,934,571.67 | - | - | - | - | 61,998,835.80 | 66,933,407.47 |

注：表中所示为本基金资产负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末均未持有交易性固定收益类投资（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于证券市场的整体波动，以及单个证券发行主体的自身经营情况或特殊事件影响。

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。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险和跟踪偏离。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。本基金投资组合中，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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2024年06月30日 |                          | 上年度末<br>2023年12月31日 |                          |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|               | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 57,626,962.23      | 93.28                    | 62,660,710.89       | 93.62                    |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 交易性金融资产—债券投资  | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 其他            | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 合计            | 57,626,962.23      | 93.28                    | 62,660,710.89       | 93.62                    |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |   |                             |                     |
|----|---|-----------------------------|---------------------|
| 假设 | 1.基金的市场价格风险决定于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数,以及业绩比较基准的变动。 |                             |                     |
|    | 2.除业绩比较基准变动外,其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。           |                             |                     |
|    | 3.贝塔系数的估计以过去一年的历史数据作为样本,采用线性回归法估计。          |                             |                     |
|    | 4.业绩比较基准的变动对基金的净值表现具有对称性影响。                 |                             |                     |
| 分析 | 相关风险变量的变动                                   | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元) |                     |
|    |   | 本期末<br>2024年06月30日          | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|    | 业绩比较基准增加1%                                  | 561,701.08                  | 631,681.49          |
|    | 业绩比较基准减少1%                                  | -561,701.08                 | -631,681.49         |

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2024年06月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 57,626,962.23      | 62,660,710.89       |
| 第二层次          | -                  | -                   |
| 第三层次          | -                  | -                   |
| 合计            | 57,626,962.23      | 62,660,710.89       |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2023年12月31日：无)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。



**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

于2024年6月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

**§7 投资组合报告**

**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 57,626,962.23 | 92.40        |
|    | 其中：股票             | 57,626,962.23 | 92.40        |
| 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      | 4,526,221.12  | 7.26         |
| 8  | 其他各项资产            | 214,934.89    | 0.34         |
| 9  | 合计                | 62,368,118.24 | 100.00       |

**7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**

**7.2.1 报告期末（指数投资）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)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 636,560.00    | 1.03         |
| B  | 采矿业              | 1,575,668.50  | 2.55         |
| C  | 制造业              | 21,936,072.35 | 35.51        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,772,498.00  | 4.49         |

|   |                 |               |       |
|---|-----------------|---------------|-------|
| E | 建筑业             | 4,315,648.16  | 6.99  |
| F | 批发和零售业          | -             | -     |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | 3,273,513.00  | 5.30  |
| H | 住宿和餐饮业          | -             | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,928,749.50  | 4.74  |
| J | 金融业             | 11,551,528.48 | 18.70 |
| K | 房地产业            | 78,024.00     | 0.13  |
| L | 租赁和商务服务业        | -             | -     |
| M | 科学研究和技术服务业      | 280,850.00    | 0.45  |
| 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         | 253,872.00    | 0.41  |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -             | -     |
| S | 综合              | -             | -     |
|   | 合计              | 49,602,983.99 | 80.29 |

### 7.2.2 报告期末（积极投资）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)      | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|--------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -            | -             |
| B  | 采矿业              | -            | -             |
| C  | 制造业              | 5,397,736.84 | 8.74          |
| 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      | 1,208,250.40 | 1.96          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -             |

|   |                 |              |       |
|---|-----------------|--------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 76,086.00    | 0.12  |
| J | 金融业             | 346,691.00   | 0.56  |
| K | 房地产业            | 470,076.00   | 0.76  |
| L | 租赁和商务服务业        | 164,226.00   | 0.27  |
| M | 科学研究和技术服务业      | -            | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 251,076.00   | 0.41  |
| 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       | 109,836.00   | 0.18  |
| S | 综合              | -            | -     |
|   | 合计              | 8,023,978.24 | 12.99 |

### 7.2.3 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。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 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所有股票投资明细

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  | 600900 | 长江电力 | 49,200  | 1,422,864.00 | 2.30         |
| 2  | 601985 | 中国核电 | 123,900 | 1,320,774.00 | 2.14         |
| 3  | 600183 | 生益科技 | 60,400  | 1,272,024.00 | 2.06         |
| 4  | 601288 | 农业银行 | 281,500 | 1,227,340.00 | 1.99         |
| 5  | 300750 | 宁德时代 | 6,800   | 1,224,204.00 | 1.98         |
| 6  | 601166 | 兴业银行 | 69,300  | 1,221,066.00 | 1.98         |
| 7  | 601669 | 中国电建 | 217,500 | 1,215,825.00 | 1.97         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 8  | 600050 | 中国联通 | 257,000 | 1,207,900.00 | 1.96 |
| 9  | 601668 | 中国建筑 | 225,656 | 1,198,233.36 | 1.94 |
| 10 | 002311 | 海大集团 | 25,300  | 1,190,365.00 | 1.93 |
| 11 | 601633 | 长城汽车 | 46,200  | 1,168,860.00 | 1.89 |
| 12 | 600309 | 万华化学 | 14,400  | 1,164,384.00 | 1.88 |
| 13 | 000725 | 京东方A | 281,900 | 1,152,971.00 | 1.87 |
| 14 | 600600 | 青岛啤酒 | 15,600  | 1,135,212.00 | 1.84 |
| 15 | 002415 | 海康威视 | 35,600  | 1,100,396.00 | 1.78 |
| 16 | 002142 | 宁波银行 | 49,700  | 1,096,382.00 | 1.77 |
| 17 | 002493 | 荣盛石化 | 113,000 | 1,091,580.00 | 1.77 |
| 18 | 601618 | 中国中冶 | 350,658 | 1,087,039.80 | 1.76 |
| 19 | 002352 | 顺丰控股 | 30,300  | 1,081,407.00 | 1.75 |
| 20 | 601211 | 国泰君安 | 79,800  | 1,081,290.00 | 1.75 |
| 21 | 600009 | 上海机场 | 33,200  | 1,070,700.00 | 1.73 |
| 22 | 002736 | 国信证券 | 117,312 | 1,019,441.28 | 1.65 |
| 23 | 601818 | 光大银行 | 303,300 | 961,461.00   | 1.56 |
| 24 | 000333 | 美的集团 | 14,600  | 941,700.00   | 1.52 |
| 25 | 600690 | 海尔智家 | 32,827  | 931,630.26   | 1.51 |
| 26 | 601919 | 中远海控 | 59,800  | 926,302.00   | 1.50 |
| 27 | 002230 | 科大讯飞 | 21,200  | 910,540.00   | 1.47 |
| 28 | 000157 | 中联重科 | 116,600 | 895,488.00   | 1.45 |
| 29 | 600919 | 江苏银行 | 119,200 | 885,656.00   | 1.43 |
| 30 | 000166 | 申万宏源 | 204,500 | 881,395.00   | 1.43 |
| 31 | 603993 | 洛阳钼业 | 95,255  | 809,667.50   | 1.31 |
| 32 | 600406 | 国电南瑞 | 32,200  | 803,712.00   | 1.30 |
| 33 | 000568 | 泸州老窖 | 5,600   | 803,544.00   | 1.30 |
| 34 | 600188 | 兖矿能源 | 33,700  | 766,001.00   | 1.24 |
| 35 | 601766 | 中国中车 | 99,575  | 747,808.25   | 1.21 |
| 36 | 601186 | 中国铁建 | 79,800  | 683,886.00   | 1.11 |
| 37 | 000792 | 盐湖股份 | 37,500  | 654,375.00   | 1.06 |
| 38 | 002304 | 洋河股份 | 8,100   | 653,994.00   | 1.06 |

|    |        |       |         |            |      |
|----|--------|-------|---------|------------|------|
| 39 | 000651 | 格力电器  | 16,500  | 647,130.00 | 1.05 |
| 40 | 002714 | 牧原股份  | 14,600  | 636,560.00 | 1.03 |
| 41 | 000338 | 潍柴动力  | 37,700  | 612,248.00 | 0.99 |
| 42 | 002601 | 龙佰集团  | 32,600  | 605,382.00 | 0.98 |
| 43 | 300957 | 贝泰妮   | 11,600  | 560,512.00 | 0.91 |
| 44 | 000100 | TCL科技 | 129,382 | 558,930.24 | 0.90 |
| 45 | 300014 | 亿纬锂能  | 12,100  | 483,032.00 | 0.78 |
| 46 | 600176 | 中国巨石  | 43,200  | 477,360.00 | 0.77 |
| 47 | 000001 | 平安银行  | 46,600  | 472,990.00 | 0.77 |
| 48 | 000776 | 广发证券  | 36,900  | 449,073.00 | 0.73 |
| 49 | 601688 | 华泰证券  | 36,100  | 447,279.00 | 0.72 |
| 50 | 600016 | 民生银行  | 105,900 | 401,361.00 | 0.65 |
| 51 | 600015 | 华夏银行  | 57,836  | 370,150.40 | 0.60 |
| 52 | 601328 | 交通银行  | 47,400  | 354,078.00 | 0.57 |
| 53 | 002202 | 金风科技  | 43,500  | 292,320.00 | 0.47 |
| 54 | 300433 | 蓝思科技  | 14,000  | 255,500.00 | 0.41 |
| 55 | 300015 | 爱尔眼科  | 24,600  | 253,872.00 | 0.41 |
| 56 | 002841 | 视源股份  | 8,400   | 248,052.00 | 0.40 |
| 57 | 002074 | 国轩高科  | 12,900  | 247,035.00 | 0.40 |
| 58 | 601009 | 南京银行  | 23,100  | 240,009.00 | 0.39 |
| 59 | 300759 | 康龙化成  | 12,500  | 232,250.00 | 0.38 |
| 60 | 600958 | 东方证券  | 28,500  | 216,600.00 | 0.35 |
| 61 | 300122 | 智飞生物  | 7,200   | 201,816.00 | 0.33 |
| 62 | 601006 | 大秦铁路  | 25,600  | 183,296.00 | 0.30 |
| 63 | 600031 | 三一重工  | 9,200   | 151,800.00 | 0.25 |
| 64 | 000938 | 紫光股份  | 6,000   | 134,100.00 | 0.22 |
| 65 | 600000 | 浦发银行  | 13,760  | 113,244.80 | 0.18 |
| 66 | 601169 | 北京银行  | 19,300  | 112,712.00 | 0.18 |
| 67 | 600089 | 特变电工  | 6,900   | 95,703.00  | 0.15 |
| 68 | 600346 | 恒力石化  | 6,600   | 92,070.00  | 0.15 |
| 69 | 601800 | 中国交建  | 9,000   | 80,460.00  | 0.13 |

|    |        |      |        |           |      |
|----|--------|------|--------|-----------|------|
| 70 | 601989 | 中国重工 | 13,200 | 65,076.00 | 0.11 |
| 71 | 600048 | 保利发展 | 6,900  | 60,444.00 | 0.10 |
| 72 | 601390 | 中国中铁 | 7,700  | 50,204.00 | 0.08 |
| 73 | 300347 | 泰格医药 | 1,000  | 48,600.00 | 0.08 |
| 74 | 600019 | 宝钢股份 | 7,100  | 47,215.00 | 0.08 |
| 75 | 300274 | 阳光电源 | 520    | 32,255.60 | 0.05 |
| 76 | 600011 | 华能国际 | 3,000  | 28,860.00 | 0.05 |
| 77 | 001979 | 招商蛇口 | 2,000  | 17,580.00 | 0.03 |
| 78 | 601111 | 中国国航 | 1,600  | 11,808.00 | 0.02 |
| 79 | 688111 | 金山办公 | 29     | 6,597.50  | 0.01 |

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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  | 688235 | 百济神州 | 4,801  | 556,147.84 | 0.90         |
| 2  | 300953 | 震裕科技 | 9,800  | 531,160.00 | 0.86         |
| 3  | 600760 | 中航沈飞 | 12,800 | 513,280.00 | 0.83         |
| 4  | 601865 | 福莱特  | 25,500 | 512,550.00 | 0.83         |
| 5  | 600848 | 上海临港 | 51,600 | 470,076.00 | 0.76         |
| 6  | 603369 | 今世缘  | 8,100  | 374,220.00 | 0.61         |
| 7  | 002240 | 盛新锂能 | 25,900 | 347,578.00 | 0.56         |
| 8  | 000301 | 东方盛虹 | 40,900 | 325,973.00 | 0.53         |
| 9  | 002120 | 韵达股份 | 38,700 | 299,538.00 | 0.48         |
| 10 | 000708 | 中信特钢 | 21,900 | 297,183.00 | 0.48         |
| 11 | 300633 | 开立医疗 | 7,200  | 284,976.00 | 0.46         |
| 12 | 603162 | 海通发展 | 28,548 | 265,496.40 | 0.43         |
| 13 | 002252 | 上海莱士 | 33,600 | 262,752.00 | 0.43         |
| 14 | 603568 | 伟明环保 | 12,200 | 251,076.00 | 0.41         |
| 15 | 601727 | 上海电气 | 67,700 | 250,490.00 | 0.41         |



|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 1  | 688111 | 金山办公 | 3,721,219.95 | 5.56 |
| 2  | 000651 | 格力电器 | 2,868,995.00 | 4.29 |
| 3  | 300750 | 宁德时代 | 2,790,216.00 | 4.17 |
| 4  | 601919 | 中远海控 | 2,687,022.00 | 4.01 |
| 5  | 600009 | 上海机场 | 2,550,048.00 | 3.81 |
| 6  | 600900 | 长江电力 | 2,493,904.00 | 3.73 |
| 7  | 002415 | 海康威视 | 2,463,689.00 | 3.68 |
| 8  | 600893 | 航发动力 | 2,446,228.00 | 3.65 |
| 9  | 600050 | 中国联通 | 2,421,713.00 | 3.62 |
| 10 | 601186 | 中国铁建 | 2,255,729.00 | 3.37 |
| 11 | 600406 | 国电南瑞 | 2,207,617.16 | 3.30 |
| 12 | 300274 | 阳光电源 | 2,204,165.00 | 3.29 |
| 13 | 002142 | 宁波银行 | 2,099,581.00 | 3.14 |
| 14 | 002601 | 龙佰集团 | 2,059,871.39 | 3.08 |
| 15 | 300760 | 迈瑞医疗 | 2,043,492.00 | 3.05 |
| 16 | 000338 | 潍柴动力 | 2,035,477.00 | 3.04 |
| 17 | 600346 | 恒力石化 | 2,005,923.00 | 3.00 |
| 18 | 600089 | 特变电工 | 2,004,719.00 | 3.00 |
| 19 | 600176 | 中国巨石 | 1,893,242.00 | 2.83 |
| 20 | 601985 | 中国核电 | 1,862,825.00 | 2.78 |
| 21 | 000166 | 申万宏源 | 1,844,643.00 | 2.76 |
| 22 | 000625 | 长安汽车 | 1,790,593.00 | 2.68 |
| 23 | 002352 | 顺丰控股 | 1,764,464.00 | 2.64 |
| 24 | 300759 | 康龙化成 | 1,713,388.00 | 2.56 |
| 25 | 002074 | 国轩高科 | 1,692,826.68 | 2.53 |
| 26 | 000157 | 中联重科 | 1,662,736.00 | 2.48 |
| 27 | 601668 | 中国建筑 | 1,647,561.00 | 2.46 |
| 28 | 600188 | 兖矿能源 | 1,631,660.00 | 2.44 |
| 29 | 002460 | 赣锋锂业 | 1,630,718.64 | 2.44 |
| 30 | 600011 | 华能国际 | 1,608,031.00 | 2.40 |
| 31 | 600031 | 三一重工 | 1,606,640.00 | 2.40 |



|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 32 | 601328 | 交通银行 | 1,593,817.00 | 2.38 |
| 33 | 601766 | 中国中车 | 1,593,448.00 | 2.38 |
| 34 | 000333 | 美的集团 | 1,554,503.00 | 2.32 |
| 35 | 601166 | 兴业银行 | 1,543,220.00 | 2.31 |
| 36 | 002230 | 科大讯飞 | 1,533,442.00 | 2.29 |
| 37 | 600690 | 海尔智家 | 1,528,848.00 | 2.28 |
| 38 | 600016 | 民生银行 | 1,506,389.00 | 2.25 |
| 39 | 601211 | 国泰君安 | 1,440,269.00 | 2.15 |
| 40 | 601006 | 大秦铁路 | 1,419,885.00 | 2.12 |
| 41 | 002714 | 牧原股份 | 1,410,221.00 | 2.11 |
| 42 | 002493 | 荣盛石化 | 1,372,408.00 | 2.05 |
| 43 | 000792 | 盐湖股份 | 1,340,123.00 | 2.00 |

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 600893 | 航发动力 | 3,530,685.00 | 5.27           |
| 2  | 688111 | 金山办公 | 3,526,658.97 | 5.27           |
| 3  | 601919 | 中远海控 | 3,508,053.10 | 5.24           |
| 4  | 000651 | 格力电器 | 2,886,584.00 | 4.31           |
| 5  | 600406 | 国电南瑞 | 2,829,885.60 | 4.23           |
| 6  | 600011 | 华能国际 | 2,808,656.00 | 4.20           |
| 7  | 600050 | 中国联通 | 2,575,567.00 | 3.85           |
| 8  | 600346 | 恒力石化 | 2,544,717.00 | 3.80           |
| 9  | 601006 | 大秦铁路 | 2,441,486.00 | 3.65           |
| 10 | 002415 | 海康威视 | 2,408,918.00 | 3.60           |
| 11 | 601766 | 中国中车 | 2,398,450.00 | 3.58           |
| 12 | 600016 | 民生银行 | 2,375,220.00 | 3.55           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 13 | 300760 | 迈瑞医疗 | 2,281,897.00 | 3.41 |
| 14 | 000166 | 申万宏源 | 2,181,014.00 | 3.26 |
| 15 | 600031 | 三一重工 | 2,172,735.00 | 3.25 |
| 16 | 300274 | 阳光电源 | 2,162,854.00 | 3.23 |
| 17 | 002074 | 国轩高科 | 2,139,538.00 | 3.20 |
| 18 | 600690 | 海尔智家 | 2,135,299.00 | 3.19 |
| 19 | 000338 | 潍柴动力 | 2,086,601.00 | 3.12 |
| 20 | 603993 | 洛阳钼业 | 1,936,329.00 | 2.89 |
| 21 | 000625 | 长安汽车 | 1,929,738.00 | 2.88 |
| 22 | 600089 | 特变电工 | 1,897,889.00 | 2.84 |
| 23 | 600019 | 宝钢股份 | 1,786,390.32 | 2.67 |
| 24 | 002202 | 金风科技 | 1,750,276.00 | 2.61 |
| 25 | 600104 | 上汽集团 | 1,724,308.00 | 2.58 |
| 26 | 601800 | 中国交建 | 1,710,013.00 | 2.55 |
| 27 | 000895 | 双汇发展 | 1,703,143.00 | 2.54 |
| 28 | 601818 | 光大银行 | 1,693,044.00 | 2.53 |
| 29 | 601390 | 中国中铁 | 1,680,541.20 | 2.51 |
| 30 | 002601 | 龙佰集团 | 1,674,962.00 | 2.50 |
| 31 | 600176 | 中国巨石 | 1,674,263.00 | 2.50 |
| 32 | 601186 | 中国铁建 | 1,665,321.00 | 2.49 |
| 33 | 600837 | 海通证券 | 1,657,430.30 | 2.48 |
| 34 | 601009 | 南京银行 | 1,640,745.00 | 2.45 |
| 35 | 601668 | 中国建筑 | 1,601,396.00 | 2.39 |
| 36 | 601211 | 国泰君安 | 1,593,735.00 | 2.38 |
| 37 | 600000 | 浦发银行 | 1,553,111.86 | 2.32 |
| 38 | 300759 | 康龙化成 | 1,541,090.25 | 2.30 |
| 39 | 601328 | 交通银行 | 1,522,299.00 | 2.27 |
| 40 | 002460 | 赣锋锂业 | 1,506,594.00 | 2.25 |
| 41 | 600009 | 上海机场 | 1,497,666.00 | 2.24 |
| 42 | 300750 | 宁德时代 | 1,487,451.00 | 2.22 |
| 43 | 002555 | 三七互娱 | 1,466,168.00 | 2.19 |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 44 | 601989 | 中国重工 | 1,396,962.00 | 2.09 |
| 45 | 600900 | 长江电力 | 1,366,464.00 | 2.04 |
| 46 | 000858 | 五粮液  | 1,355,918.00 | 2.03 |

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 172,358,847.89 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 179,571,715.30 |

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 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。

### 7.6 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。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。套期保值主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金暂不投资国债期货。

**7.11.2 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。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾因流动资金贷款被用于固定资产投资等十三项违法违规事实受到行政处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

**7.12.2** 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。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额         |
|----|-------|------------|
| 1  | 存出保证金 | -          |
| 2  | 应收清算款 | -          |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 214,934.89 |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 214,934.89 |

**7.12.4 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。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.5.2 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。

### 7.12.6 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。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别            | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构         |        |               |        |
|-----------------|----------|-----------|---------------|--------|---------------|--------|
|                 |          |           | 机构投资者         |        | 个人投资者         |        |
|                 |          |           | 持有份额          | 占总份额比例 | 持有份额          | 占总份额比例 |
| 财通中证ESG100指数增强A | 2,549    | 13,983.40 | 12,807,344.30 | 35.93% | 22,836,351.48 | 64.07% |
| 财通中证ESG100指数增强C | -        | -         | -             | -      | -             | -      |
| 合计              | 2,549    | 13,983.40 | 12,807,344.30 | 35.93% | 22,836,351.48 | 64.07% |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别            | 持有份额总数<br>(份) | 占基金总份额比<br>例 |
|------------------|-----------------|---------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 财通中证ESG100指数增强A | 41,856.38     | 0.1174%      |
|                  | 财通中证ESG100指数增强C | -             | -            |
|                  | 合计              | 41,856.38     | 0.1174%      |

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                                     | 份额级别                | 持有基金份额总量的数量区<br>间（万份） |
|--|---------------------|-----------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式<br>基金 | 财通中证ESG100指<br>数增强A | 0                     |
|  | 财通中证ESG100指<br>数增强C | 0                     |
|  | 合计                  | 0                     |
| 本基金基金经理持有本开放式基<br>金                    | 财通中证ESG100指<br>数增强A | 0~10                  |
|  | 财通中证ESG100指<br>数增强C | 0                     |
|  | 合计                  | 0~10                  |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                | 财通中证ESG100指数<br>增强A | 财通中证ESG100指数<br>增强C |
|--------------------------------|---------------------|---------------------|
| 基金合同生效日(2013年03月22<br>日)基金份额总额 | 247,395,794.87      | -                   |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 39,866,628.33       | -                   |

|               |               |   |
|---------------|---------------|---|
| 本报告期基金总申购份额   | 2,543,833.54  | - |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 6,766,766.09  | - |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -             | - |
| 本报告期期末基金份额总额  | 35,643,695.78 | - |

注：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。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所，为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 财通证券 | 2      | 351,930,563.19 | 100.00%      | 138,319.43 | 100.00%    | -  |

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全的证券经营机构；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1)投资、研究部门与券商联系商讨合作意向，根据公司对券商交易单元的选择标准，确定选用交易单元的所属券商以及（主）交易单元，报投资总监与总经理审核批准；
- (2)集中交易部与券商商议交易单元租用协议，经相关业务部门确认后，报公司领导审批；
- (3)基金清算部负责对接托管行、各证券交易所、中登公司上海和深圳分公司办理交易单元手续及账户开户手续。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式    | 法定披露日期     |
|----|--|-----------|------------|
| 1  | 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2023年第4季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-01-20 |
| 2  | 关于华融融达期货股份有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告          | 中国证监会规定媒介 | 2024-02-03 |
| 3  | 关于和合期货有限公司终止                                   | 中国证监会规定媒介 | 2024-02-29 |



|    |  |           |            |
|----|--|-----------|------------|
|    | 代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告                          |           |            |
| 4  | 关于北京增财基金销售有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告          | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-29 |
| 5  | 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2023年年度报告   | 中国证监会规定媒介 | 2024-03-30 |
| 6  | 关于深圳新华信通基金销售有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告        | 中国证监会规定媒介 | 2024-04-13 |
| 7  | 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2024年第1季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-04-20 |
| 8  | 关于天相投资顾问有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告            | 中国证监会规定媒介 | 2024-04-26 |
| 9  | 关于民商基金销售（上海）有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告        | 中国证监会规定媒介 | 2024-04-27 |
| 10 | 关于深圳富济基金销售有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告          | 中国证监会规定媒介 | 2024-05-17 |
| 11 | 财通基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告          | 中国证监会规定媒介 | 2024-06-07 |

|    |  |           |            |
|----|--|-----------|------------|
| 12 | 关于江苏天鼎证券投资咨询有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告                      | 中国证监会规定媒介 | 2024-06-14 |
| 13 | 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产品资料概要更新（2024年06月29日公告） | 中国证监会规定媒介 | 2024-06-29 |
| 14 | 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更新招募说明书（2024年06月29日公告）    | 中国证监会规定媒介 | 2024-06-29 |

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内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              | 2024-01-01至2024-06-30  | 12,806,736.68 | -    | -          | 12,806,736.68 | 35.93% |
| 产品特有风险  |                |                        |               |      |            |               |        |
| 当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。 |                |                        |               |      |            |               |        |

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、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；
- 3、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；
- 4、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招募说明书及其更新；
- 5、报告期内披露的各项公告；
- 6、法律法规要求备查的其他文件。

## 12.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43/45楼。

## 12.3 查阅方式

投资者可在本基金管理人网站上免费查阅备查文件，对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：[www.ctfund.com](http://www.ctfund.com)

财通基金管理有限公司  
二〇二四年八月三十一日