（上接 C35 版）

电话：010-56075718
传真：010-67767615
客服电话：4006-802-123
公司网址：www.zhixin-inv.com
(84)天津国美基金销售有限公司
注册地址：天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801
办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 9 层
法人代表：丁东华
联系人：郭宝亮
电话：010-59287984
传真：010-59287825
客服电话：400-111-0889
公司网址：www.gomefund.com
(85)深圳前海财厚基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区南山大道 1088 号南园枫叶大厦 15 层 15K 室
法人代表：杨艳平
联系人：李军
传真：0755-86575665
客服电话：400-1286-800
公司网址：www.caiho.cn
(86) 乾道盈泰基金销售（北京）有限公司
注册地址：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室
办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室
法定代表人：董云巍
联系人：宋子琪
电话：010-62062880
传真：010-82057741
客服电话：4000-888-080
公司网址：www.qiandaojr.com
(87) 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23 楼 A 座
法定代表人：高锋
联系人：廖苑兰
客服电话：400 804 8688
公司网址：www.keynesasset.com
(88)河南和信证券投资顾问股份有限公司
注册地址：郑州市郑东新区金水东路南、农业东路西 1 号楼美盛中心 2405
办公地址：郑州市郑东新区金水东路 33 号 美盛中心 24 楼北区
法人代表：吴跃平
联系人：房磊
电话：0371-61777565
传真：0371-61777560
客服电话：0371-61777558
公司网址：www.jeweldia.com
(89) 凤凰金信（银川）基金销售有限公司
注册地址：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402
办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼
法人代表：程刚
联系人：张旭
电话：010-58160168
传真：010-58160173
客服电话：400-810-5919
公司网址：www.fengfd.com
(90)北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 室
办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 室
法人代表：王伟刚
联系人：熊小满
电话：010-56251471
传真：010-62680827
客服电话：400-619-9059
公司网址：www.hcjijin.com
(91)和耕传承基金销售有限公司
注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风东路东、康宁街北 6 号楼 6 楼 602、603 房间办公地址：河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503
法定代表人：王旋
联系人：郭兆英
电话：0371-55213196
传真：0371-85518397
客服电话：4000-555-671
公司网址：www.hgccpb.com
(92)嘉兴银行股份有限公司
注册地址：浙江省嘉兴市昌盛南路 1001 号
办公地址：浙江省嘉兴市昌盛南路 1001 号
法定代表人：夏林生
联系人：陈兢
电话：0573-82082676
传真：0573-82062161
客服电话：0573-96528
公司网站：www.jxccb.com
(93)贵州华阳众惠基金销售有限公司
注册地址：贵州省黔东南苗族侗族自治州丹寨县金钟经济开发区 C 栋标准厂房
办公地址：贵州省贵阳市云岩区北京路 9 号君派大厦 16 楼
法人代表：程雷
联系人：陈敏
电话：0851-86909950
传真：0851-86909950
客服电话：400-839-1818
公司网址：www.hyzhfund.com
(94) 上海挖财基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室
法人代表：冷飞
联系人：李娟
电话：021-50810687
传真：021-58300279
客服电话：021-50810673
公司网址：wacaijijin.com
(95)江西银行股份有限公司
注册地址：江西省南昌市红谷滩新区金融大街 699 号
办公地址：江西省南昌市红谷滩新区金融大街 699 号
法定代表人：陈晓明
联系人：陈云波
电话：0791-86796029
传真：0791-86790795
客服电话：956055
公司网址：www.jx-bank.com
(96)中期资产管理有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号
办公地址：北京市朝阳区光华路 16 号中期大厦 A 座
法定代表人：姜新
联系人：方艳美
电话：010-65807865
传真：010-658007864
客服电话：010-65807865
公司网址：www.cifcofund.com
(97) 通华财富（上海）基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室
办公地址：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 9 楼
法定代表人：沈丹义
联系人：周晶
业务传真：021-60818280
客服热线：400-101-9301 或 95193-5
公司网址：www.tonghuafund.com
(98)海银基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室
办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼
法人代表：惠晓川
联系人：陈颖
电话：021-80133597
传真：021-80133413
客服电话：400-808-1016
公司网址：www.fundhaiyin.com
(99)上海农村商业银行股份有限公司
注册地址：上海市黄浦区中山东二路 70 号
办公地址：上海市黄浦区中山东二路 70 号
法定代表人：冀光恒
联系人：施传荣
电话：021-38523692
传真：021-50105124
客服电话：021-962999
公司网址：www.srcb.com
(100) 上海云湾投资管理限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层，200127
办公地址：中国上海浦东新区锦康路 308 号陆家嘴世纪金融广场 6 号楼
法人代表：桂水发
联系人：范泽杰
电话：021-20530186
传真：021-20539999
客服电话：400-820-1515
网址：www.zhengtongfunds.com
(101) 北京电盈基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区酒仙桥路 14 号 53 号楼 7 层 719 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
(102) 万家财富基金销售（天津）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
传真：010-59013828
客服电话：010-59013895
公司网址：www.wanjiawealth.com
(103) 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 号中科金座大厦
办公地址：河南省郑州市郑东新区 CBD 商务外环路 23 号中科金座大厦
法人代表人：窦荣兴
联系人：赵栋一
电话：0371-85519823
传真：0371-85519869
客服电话：95186
公司网址：www.zybank.com.cn
(104)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：www.phoenix-capital.com.cn
(105)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
(106) 上海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：021-60907378
公司网址：www.youyufund.com
(107)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
传真：010-56081694
客服电话：400-188-8848
公司网址：www.1314fund.com
(108)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：400-021-6088
公司网址：www.gxjlcn.com
(109)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：吕春卫
联系人：丁倩云
电话：01086499427
客服电话：4006206868
公司网址：www.lczq.com
(110)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（811-812）
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
(111)南京途牛基金销售有限公司
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：jr.tuniu.com
(112) 沈阳麟龙投资顾问有限公司
注册地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B 座 601
办公地址：上海市青云路 158 号城建大厦 5 楼
法定代表人：朱荣晖
联系人：钱金菊
电话：021-5109-1679
传真：021-51091674
客服电话：024-62836088
公司网址：www.linlongtougu.com
(113)济安财富(北京)基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307
办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307
法定代表人：杨健
联系人：李海燕
电话：010-65309516
传真：010-65330699
客服电话：400-673-7010
公司网址：www.jianfortune.com
(114)江海证券有限公司
注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
办公地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
法定代表人：赵洪波
联系人：姜志伟
联系电话：0451-87765732
客服电话：400-666-2288
公司网址：www.jhzq.com.cn
(115)中山证券有限责任公司
注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层
办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层
法定代表人：黄扬录
联系人：罗艺琳
电话：0755-82570586
客服电话：95329
公司网址：www.zszq.com
(116)弘业期货股份有限公司
注册地址：南京市中华路 50 号
办公地址：南京市中华路 50 号弘业大厦
法定代表人：周剑秋
联系人：张苏怡
电话：025-52278981
传真：025-52278733
客服电话：400-8281288
公司网址：www.ftol.com.cn
(117)民商基金销售（上海）有限公司
注册地址：上海黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室
办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼
法定代表人：贲惠琴
联系人：杨一新
电话：021-50206002
传真：021-50206001
客户电话：021-50206003
网址：msftec.com
（118）长江期货股份有限公司
注册地址：武汉市武昌区中北路 9 号长城汇 T2 号写字楼第 27、28 层
办公地址：武汉市武昌区中北路 9 号长城汇 T2 号写字楼第 27、28 层
法定代表人：罗国华
客服电话：95579/027-85861133
网址：www.cjfco.com.cn
（119）江苏汇林保大基金销售有限公司
注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号
办公地址：上海市龙华东路 868 号绿地海外滩办公 A1605 室
法定代表人：吴言林
联系人：孙平
电话：025-66046166
传真：025-56663409
客服电话：025-66046166
公司网址：www.huilinbd.com
（120）阳光人寿保险股份有限公司
注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层
办公地址：北京市朝阳区朝外大街乙 12 号昆泰国际大厦
法定代表人：李科
联系人：杨超
电话：010-85632771
客服电话：95510
公司网址：https://www.sinosig.com
（121）中国人寿保险股份有限公司
注册地址：中国北京市西城区金融大街 16 号
办公地址：中国北京市西城区金融大街 16 号
法定代表人：王滨
联系人：秦泽伟
电话：010-63631539
传真：010-66222276
客服电话：95519
公司网址：www.e-chinalife.com
（122）喜鹊财富基金销售有限公司
注册地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室
办公地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室
法定代表人：陈皓
客服电话：4006997719
公司网址：www.xiquefund.com
（123）方德保险代理有限公司
注册地址：北京市东城区东直门外大街 46 号 12 层 02 室
办公地址：北京市东城区东直门外大街 46 号 12 层 02 室
法定代表人：林柏均
客服电话：010-64068617
公司网站：www.fundsure.cn
（124）和合期货有限公司
注册地址：山西省太原市迎泽区菜园东街 2 号
办公地址：山西省太原市迎泽区菜园东街 2 号
法定代表人：刘晓浩
联系人：张基甲
电话：0351-7342798
传真：0351-7342538
客服电话：400-660-4882
公司网址：www.hhqh.com.cn
（125）中信证券华南股份有限公司
注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼
办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼
法定代表人：胡伏云
联系人：龙江虹
电话：020-88836999
客服电话：95548
公司网址：www.gzs.com.cn
基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金。

（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：夏理芬
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、骆文慧
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
本基金所构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及策略性投资的需要，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 2020 年 4 月 21 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 2020 年 3 月 31 日。

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	216,013,417.04	92.04
	其中：股票	216,013,417.04	92.04
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	17,639,060.00	7.52
8	其他资产	1,053,184.86	0.45
9	合计	234,705,661.90	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（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	-	-
B	采矿业	6,352,736.50	2.72
C	制造业	79,221,704.21	33.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,365,766.08	3.58
E	建筑业	13,888,311.84	5.95
F	批发和零售业	5,002,076.40	2.14
G	交通运输、仓储和邮政业	11,334,493.18	4.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,256,290.64	2.68
J	金融业	42,844,113.01	18.35
K	房地产业	10,427,205.30	4.47
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	3,225,379.52	1.38
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	186,918,076.68	80.07

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	1,998,753.60	0.86
B	采矿业	89,600.00	0.04
C	制造业	16,237,276.59	6.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	169,980.80	0.07
E	建筑业	1,849,284.81	0.79
F	批发和零售业	1,925,567.63	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	463,730.89	0.20
H	住宿和餐饮业	26,477.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,572,599.00	1.10
J	金融业	2,777,703.79	1.19
K	房地产业	300,960.57	0.13
L	租赁和商务服务业	269,826.57	0.12
M	科学研究和技术服务业	29,832.98	0.01
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	161,037.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	222,709.13	0.10
S	综合	-	-
	合计	29,095,340.36	12.46

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。

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

3.1 报告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

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	002142	宁波银行	197,191	4,547,224.46	1.95
2	601398	工商银行	749,100	3,857,865.00	1.65
3	601633	长城汽车	413,600	3,676,904.00	1.58
4	600000	浦发银行	355,303	3,606,325.45	1.54
5	600066	宇通客车	262,249	3,590,188.81	1.54
6	000157	中联重科	621,367	3,535,578.23	1.51
7	601668	中国建筑	670,140	3,531,637.80	1.51
8	002146	荣盛发展	452,431	3,506,340.25	1.50
9	601377	兴业证券	557,700	3,485,625.00	1.49
10	601390	中国中铁	640,386	3,445,276.68	1.48

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

序号	股票代码	股票名称	数量	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	601577	长沙银行	286,131	2,211,792.63	0.95
2	300118	东方日升	143,100	1,631,340.00	0.70
3	600170	上海建工	498,361	1,599,738.81	0.69
4	300016	北陆药业	180,600	1,558,578.00	0.67
5	300552	万集科技	20,600	1,410,276.00	0.60

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，根据公开信息显示，本基金投资的前十名证券宁波银行（证券代码：002142）分别于 2019 年 7 月 5 日、2019 年 12 月 13 日因违反信贷政策、违反房地产行业政策、违规开展存贷业务、员工管理不到位、向监管部门报送的报表不准确等；销售行为不合规、双录管理不到位；设立时点性规模考核指标，股权质押管理不合规受到处罚。浦发银行（证券代码：600000）因对成都分行授信业务及整改情况严重失察，重大审计发现未向监管部门报，轮岗制度执行不力受到处罚。中联重科（证券代码：000157）因提供不真实统计资料受到处罚。荣盛地产（证券代码：002146）于 2020 年 1 月 3 日，因四季花语地块七（一期）项目中擅自改变建筑物的形式受罚款。中国建筑（证券代码：601668）分别于 2019 年 6 月 17 日、2019 年 8 月 7 日，因未将事故隐患排查治理情况如实记录并向从业人员通报；九江港彭泽港区红光作业综合枢纽码头一期工程项目施工标段，2019 年 3 月 15 日存在码头水工结构工程为根据不同施工阶段和周围环境变化中施工现场采取相应的安全施工措施的为题逾期未改正的违法事实受到处罚。中国中铁（证券代码：601390）于 2020 年 1 月 6 日，因未在施工现场的危险部位设置明显的安全警示标志受到处罚。除上述情况外，本基金投资的其他前四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。
本基金投资上述标的的投资决策程序为：
1、投资决策委员会确定每个产品的基本投资逻辑；
2、投资研究体系中的研究平台是一个共享平台，为投资决策全流程提供研究支持；
3、基金经理拟订所管理产品的投资计划与方案；
4、金融工程小组对基金经理 / 投资经理的投资计划进行风险评价，并向投资决策委员会提交评估报告；
5、投资决策委员会对基金经理 / 投资经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要；
6、根据决策纪要，基金经理 / 投资经理对计划方案进行具体实施；
7、中央交易室按有关交易规则执行基金经理 / 投资经理下达的交易指令，并将有关信息进行反馈；
8、基金经理 / 投资经理定期检讨投资组合的运作成效；
9、金融工程小组定期为投资决策委员会、投资总监、基金经理 / 投资经理出具绩效与风险评估报告。
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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,013,511.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,441.07
5	应收申购款	35,232.51
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,053,184.86

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
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
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