上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

一、重要声明与提示

上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号（上市交易公告书的内容与格式）》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，海富通基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）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。本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2011年3月18日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》及海富通基金管理有限公司网站（http://www.hftfund.com）上的《上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

二、基金概览

1、基金二级市场交易简称：非周ETF。
2、二级市场交易代码：510120。
3、基金申购、赎回简称：非周申赎。
4、申购、赎回代码：510121。
5、2011年5月31日基金份额总额：274,792,376份。
6、2011年5月31日基金份额净值：2.205元。
7、本次上市交易份额：274,792,376份。
8、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
9、上市交易日期：2011年6月8日。
10、基金管理人：海富通基金管理有限公司。
11、基金托管人：中国工商银行股份有限公司。
12、上市推荐人：海通证券股份有限公司。
13、申购赎回代办券商（以下简称“一级交易商”）：渤海证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、江海证券有限公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：2011年2月23日中国证券监督管理委员会证监许可【2011】268号文。
2、基金运作方式：交易型、开放式。
3、基金合同期限：不定期。
4、发售日期：本基金自2011年3月21日起至2011年4月15日止通过销售机构公开发售。其中，网下现金发售期间为2011年3月21日至2011年4月15日，网上现金发售日期为2011年4月13日至2010年4月15日，通过发售代理机构及基金管理人进行网下股票认购的发售期间为2011年3月21日至2011年4月15日。
5、发售价格：1.00元人民币。
6、发售期限：网下现金发售18个工作日，网上现金发售3个工作日，通过发售代理机构进行网下股票认购18个工作日。
7、发售方式：投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。
8、发售机构
①直销机构
投资者可通过本基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金认购和网下股票认购。
②代销机构
网下现金发售代理机构和网下股票发售代理机构：
海通证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、德邦证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、方正证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、华龙证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司、江海证券有限公司、民生证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、山西证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、中山证券有限责任公司、中国建银投资证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、中国民族证券有限责任公司、广发华福证券有限责任公司、中信金通证券有限责任公司、信达证券股份有限公司（其中财富证券有限责任公司和中国国际金融有限公司不代理网下股票认购）。
网上现金发售代理机构包括具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司：爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、北京高华证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、财达证券有限责任公司、财富里昂证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、大同证券经纪有限责任公司、德邦证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、方正证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广发华福证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、国海证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、华林证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、金元证券股份有限公司、联讯证券有限责任公司、民生证券有限责任公司、南京证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、日信证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、天风证券有限责任公司、天源证券经纪有限公司、万联证券有限责任公司、五矿证券经纪有限责任公司、西部证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、厦门证券有限公司、湘财证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、浙商证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、中国民族证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、中天证券有限责任公司、中信建投证券有限责任公司、中信金通证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、恒泰长财证券有限责任公司、万和证券经纪有限公司、西藏同信证券有限责任公司、中邮证券有限责任公司等。

（二）基金合同生效
上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金自2011年3月21日起向社会公开募集，截至2011年4月15日募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，此次募集的有效净认购金额为人民币652,293,929.00元（含所募集股票市值）。依照《上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，认购资金的银行利息14,480.00元折算成基金份额已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。本次募集认购资金已于2011年4月21日全额划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的基金托管专户，所募集股票已于2011年4月20日由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理过户。
按照每份基金份额面值人民币1.00元计算，本基金募集期间含本息（含所募集股票市值）共募集652,308,409.00份基金份额，有效认购户数为10316户。其中本基金管理人及本基金管理人的从业人员没有认购本基金。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2011年4月22日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

（三）基金份额折算
根据《上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金管理人确定2011年5月18日为本基金的基金份额折算日。当日上证非周期行业100指数收盘值为2,341.426点，基金资产净值为643,417,367.51元，折算前基金份额总额为652,308,409份，折算前基金份额净值为0.986元。
根据《上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》中约定的基金份额折算公式，基金份额折算比例为0.42126887（以四舍五入的方法保留小数点后8位），折算后基金份额总额为274,792,376份，折算后基金份额净值为2.341元。
本基金管理人已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于2011年5月19日进行了变更登记。折算后的基金份额采取截位法保留到整数位，由此产生的误差计入基金财产。投资者可以自2011年5月20日起在其上海证券交易所证券账户指定的销售机构查询折算后其持有的基金份额。
本基金管理人和基金托管人已根据折算后的基金份额总额进行了相应的会计处理，并互相核对。

（四）基金上市交易
1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所上证债字【2011】105号。
2、上市交易日期：2011年6月8日。
3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
4、基金二级市场交易简称：非周ETF。
5、二级市场交易代码：510120。
投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。
6、基金申购、赎回简称：非周申赎。
7、申购、赎回代码：510121。
投资者应当在本基金指定的一级交易商办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。
目前本基金的一级交易商包括：渤海证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、江海证券有限公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司。
8、本次上市交易份额：274,792,376份。
9、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数
截至2011年5月31日，本基金份额持有人户数为10316户，平均每户持有的基金份额为26637份。

（二）持有人结构
截至2011年5月31日，本基金份额持有人结构如下：
机构投资者持有的基金份额为118,265,100份，占基金总份额的43.04%；个人投资者持有的基金份额为156,527,276份，占基金总份额的56.96%。

（三）前十名基金份额持有人的情况：
截至2011年5月31日，前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占总份额比例（%）
1	中航证券-浦发-中航金航2号集合资产管理	12,639,582.00	4.5997
2	红塔证券股份有限公司	12,638,066.00	4.5991
3	东兴证券-光大-东兴1号优选基金集合资产	10,531,721.00	3.8326
4	中国平安人寿保险股份有限公司-万能-个险	8,426,219.00	3.0664
5	宏源证券股份有限公司	6,319,664.00	2.2998
6	财富证券有限责任公司	5,266,492.00	1.9165
7	兴业证券股份有限公司	5,055,226.00	1.8397
8	应美美	4,296,942.00	1.5637
9	海通证券股份有限公司	4,213,340.00	1.5333
10	财富证券有限责任公司	4,213,194.00	1.5332

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人
1、名称：海富通基金管理有限公司
2、法定代表人：邵国有
3、总经理：田仁灿
4、注册资本：1.5亿元人民币
5、注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层
6、批准设立机关及设立批准文号：中国证监会证监基金字【2003】48号
7、工商登记注册的法人营业执照文号：310000400339452
8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。
9、股权结构：海通证券股份有限公司51%、法国巴黎投资管理BE控股公司49%。
10、内部组织结构及职能：
公司按照建立和完善公司治理结构的要求，设立董事会和监事会，并聘请了4名独立董事。为强化董事会的监督和指导功能，促进公司各项业务稳健发展，董事会设立了风险委员会、薪酬委员会、审计委员会三个专业委员会，其成员以独立董事为主。
董事会决定公司的战略规划，强化各项审计稽核监察职能，充分保障公司基金持有人的利益，为公司的健康发展提供最佳的资源支持，并且为保护基金持有人的利益提供最佳保障。董事会由九位董事组成，其中四名为独立董事。
监事会由三名监事组成，其中一名监事为公司职工代表，由公司职工民主选举和罢免。其余成员由股东会选举和罢免。监事会向股东会负责，并向股东会汇报工作情况。
公司实行董事会领导下的总经理负责制。总经理全面负责公司的经营管理。公司下设运营部、渠道业务部、机构业务部、营销部、投资部、监察稽核部、风险管理部、法律部、人力资源部、战略发展部、财务部等部门。公司按照合理配置技能、有效激励和强调从业经验等原则，严把人员聘用关，公司员工覆盖基金运作的各个环节，能够保证本基金募集后顺利、规范运作。
11、人员情况：
截止2011年3月31日，公司正式员工194人，其中55%的员工具有硕士以上学历。
12、信息披露负责人：奚万荣
电话：021-38650891
13、基金管理业务情况简介：
截至2011年3月31日，海富通基金管理有限公司旗下共管理16只开放式基金，资产规模达417亿元人民币。旗下管理的基金包括：海富通精选证券投资基金、海富通股票证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势股票型证券投资基金、海富通精选或写混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通中国海外精选股票型证券投资基金、海富通领先成长股票型证券投资基金、海富通中证100指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘股票型证券投资基金、上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金及海富通大中华精选股票型证券投资基金。
14、本基金基金经理
刘璎女士，基金经理，硕士，9年证券从业经历。先后任职于交通银行、华安基金管理有限公司，曾任华安上证180ETF基金基金经理助理；2007年3月至2010年6月担任华安上证180ETF基金基金经理，2008年4月至2010年6月担任华安中国A股增强指数基金基金经理。2010年6月加入海富通基金管理有限公司。2010年11月起任海富通上证周期ETF基金及海富通上证周期ETF联接基金基金经理，2011年4月起兼任海富通上证非周期ETF基金及海富通上证非周期ETF联接基金基金经理。

（二）基金托管人情况
1、名称：中国工商银行股份有限公司
2、住所：北京市西城区复兴门内大街55号
3、办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
4、成立时间：1984年1月1日
5、法定代表人：姜建清
6、批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发【1983】146号）
7、注册资本：人民币334,018,850,026元
8、存续期间：持续经营
9、联系人：赵会军
10、联系电话：021-66105799
11、基金托管部人员情况
截至2011年3月末，中国工商银行资产托管部共有员工130人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。
12、基金托管业务经营情况
作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2011年3月，中国工商银行共托管证券投资基金205只，其中封闭式8只，开放式197只。自2003年以来，本行连续七年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的25项最佳托管银行大奖；2010年，本行资产托管部总经理获得《财资》设立的年度中国最佳托管银行家个人大奖。本行是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（三）上市推荐人
海通证券股份有限公司
住所：上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人：王开国
联系人：李笑鸣
电话：021-23219275
客户服务电话：400-8888-001,95553
网址：www.htsec.com

（四）一级交易商
本基金申购赎回代办券商（一级交易商）名单如下：渤海证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、红塔证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、江海证券有限公司、平安证券有限责任公司、齐鲁证券有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司。

（五）基金验资机构
普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法人代表：杨绍信
经办注册会计师：薛竞、金毅
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：金毅

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用
本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用从基金认购费用中支付，不由基金资产承担。

（二）基金上市前重要财务事项
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表
本基金截至2011年05月31日的资产负债表如下：

资 产	本报告期末
资 产：	
银行存款	24,043,144.36
结算备付金	3,244,855.59
存出保证金	-
交易性金融资产	579,000,246.33
其中：股票投资	579,000,246.33
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	155,116.06
应收股利	388,620.40
应收申购款	-
其他资产	92,468.88
资产总计	606,924,451.62
负债和所有者权益	
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	268,412.11
应付托管费	53,682.41
应付销售服务费	-
应付交易费用	525,834.73
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	77,065.39
负债合计	924,994.64
所有者权益：	
实收基金	652,308,409.00
未分配利润	-46,308,952.02
所有者权益合计	605,999,456.98
负债和所有者权益总计	606,924,451.62

注：1、截至2011年05月31日，基金份额净值2.205元，基金份额总额274,792,376份。
2、本报告期自2011年04月22日起至2011年05月31日止。本基金合同于2011年04月22日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满半年。

八、基金投资组合

截至2011年05月31日，本基金的投资组合情况如下：

（一）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	579,000,246.33	95.40
	其中：股票	579,000,246.33	95.40
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	27,287,999.95	4.50
6	其他资产	636,205.34	0.10
7	合计	606,924,451.62	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

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	8,469,907.00	1.40
B	采掘业	-	-
C	制造业	324,196,406.26	53.50
C0	食品、饮料	60,406,384.44	9.97
C1	纺织、服装、皮毛	10,992,707.46	1.81
C2	木材、家具	2,146,712.40	0.35
C3	造纸、印刷	1,966,505.60	0.32
C4	石油、化学、塑胶、塑料	23,544,584.96	3.89
C5	电子	8,954,844.72	1.48
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	171,895,902.68	28.37
C8	医药、生物制品	38,662,749.00	6.38
C99	其他制造业	5,626,015.00	0.93
D	电力、煤气及水的生产和供应业	47,372,169.30	7.82
E	建筑业	63,078,012.89	10.41
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	53,753,038.76	8.87
H	批发和零售贸易	40,269,477.24	6.65
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	12,094,264.63	2.00
L	传播与文化产业	2,988,788.20	0.49
M	综合类	26,778,182.05	4.42
	合计	579,000,246.33	95.54

（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	600519	贵州茅台	168,908.00	34,423,450.40	5.68
2	600031	三一重工	1,336,008.00	22,444,934.40	3.70
3	600050	中国联通	3,791,943.00	21,651,994.53	3.57
4	601668	中国建筑	5,273,100.00	19,774,125.00	3.26
5	600900	长江电力	2,174,812.00	16,093,608.80	2.66
6	600089	特变电工	890,800.00	15,758,252.00	2.60
7	601989	中国重工	1,209,577.00	13,704,507.41	2.26
8	600104	上海汽车	812,225.00	13,442,323.75	2.22
9	600795	国电电力	4,111,000.00	12,744,100.00	2.10
10	600887	伊利股份	351,546.00	12,254,893.56	2.02

（四）按券种分类的债券投资组合
截至2011年05月31日，本基金未持有债券。

（五）按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细
截至2011年05月31日，本基金未持有债券。

（六）投资组合报告附注
1、自基金合同生效日至2011年05月31日，本基金前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。
2、本基金前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
3、其他资产构成如下：

序号	其他资产	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	155,116.06
4	应收股利	388,620.40
5	其他应收款	92,468.88
6	合计	636,205.34

4、权证投资情况
截至2011年05月31日，本基金未持有权证；自基金合同生效日至2011年05月31日，本基金未投资任何权证。
5、本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
截至2011年05月31日，本基金未持有可转换债券。
6、本报告期末按市值占基金净值比例大小排序的所有资产支持证券明细
截至2011年05月31日，本基金未持有资产支持证券。
7、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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

以2011年5月18日为基金份额折算日，本基金进行了基金份额折算，具体内容详见第三章的“（三）基金份额折算”。

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产。
（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。
基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。
基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为海通证券股份有限公司。
上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：
1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件；
2、基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

十三、备查文件目录

（一）中国证监会批准上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
（二）《上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
（三）《上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
（四）注册登记协议
（五）基金管理人业务资格批件、营业执照
（六）基金托管人业务资格批件、营业执照
（七）海富通基金管理有限公司募集设立上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金的法律意见书
备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可向基金管理人、基金托管人申请查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇一一年六月二日

附件：基金合同摘要

一、基金合同当事人及权利义务
（一）基金管理人的权利与义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：
①依法募集基金；
②自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
③依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
④销售基金份额；
⑤召集基金份额持有人大会；
⑥依据基金合同及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
⑦在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
⑧选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理；
⑨）担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得基金合同规定的费用；
⑩依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案；
⑪）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
⑫）在符合有关法律法规和基金合同的前提下，决定和调整除调高管理费率和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式；
⑬）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
⑭）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资融券；
⑮）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
⑯）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
⑰）法律法规和基金合同规定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：
①）依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回等注册登记事宜；如认为基金代销机构违反基金合同、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
②）办理基金备案手续；
③）自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
④）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
⑤）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
⑥）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
⑦）依法接受基金托管人的监督；
⑧）采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购赎回对价清单；
⑨）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
⑩）编制季度、半年度和年度基金报告；
⑪）严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
⑫）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
⑬）按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
⑭）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
⑮）依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
⑯）按照法律法规规定的年限保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料；
⑰）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
⑱）组织并参加基金财产清算小组、参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
⑲）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
⑳）因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
㉑）监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
㉒）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方责任导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失，而基金管理人首先承担了责任的情况下，基金管理人有权向第三方追偿；
㉓）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
㉔）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金投资者；
㉕）执行生效的基金份额持有人大会的决定；
㉖）建立并保存基金份额持有人名册，根据托管协议的约定定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册；
㉗）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。
（二）基金托管人的权利与义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：
①）自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
②）依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
③）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
④）以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；
⑤）以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；
⑥）以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算；
⑦）提议召开或召集基金份额持有人大会；
⑧）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
⑨）法律法规和基金合同规定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：
①）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
②）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
③）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
④）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
⑤）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
⑥）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
⑦）保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
⑧）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；
⑨）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
⑩）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行