# 上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2012年第1号）

## 基金管理人：海富通基金管理有限公司
## 基金托管人：中国工商银行股份有限公司

### 重要提示

上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金（以下简称"本基金"）经2010年7月23日中国证券监督管理委员会证监许可【2010】985号文核准募集。本基金的基金合同于2010年9月19日正式生效。本基金类型为交易型开放式。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险以及基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险，基金份额二级市场交易价格折溢价的风险，基金的退市风险，投资者申购、赎回失败的风险以及基金份额赎回对价的变现风险等等。本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资者在申购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2012年3月19日，有关财务数据和净值表现截止日为2011年12月31日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

### 一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：海富通基金管理有限公司
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
办公地址：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
法定代表人：邵国有
成立时间：2003年4月18日
电话：021-38650999
联系人：包瑾
注册资本：1.5亿元人民币
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%。

（二）主要人员情况

邵国有先生，董事长，副教授。历任吉林大学校党委副书记、长春师范学院校党委书记、长春新世纪广场有限公司副董事长兼总经理、海通证券股份有限公司宣传培训中心总经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事长。

吉宇光先生，董事，硕士，高级经济师。历任交通银行北京分行办公室副主任、交通银行北京分行证券部经理、海通证券北京朗家园营业部总经理等职。1997年至今任海通证券股份有限公司副总裁。

艾德加（Stewart Edgar）先生，董事，英国籍，学士。历任英国Ivory & Sime公共有限公司基金经理，美国Fiduciary国际信托公司研究部主任、高级副总裁，英国HD国际有限公司高级基金经理、董事，美国F&C管理公司高级基金经理、董事，比利时富通基金管理公司董事总经理，法国巴黎投资管理公司亚太区董事总经理。

田仁灿先生，董事、总经理，比利时籍，工商管理硕士。历任法国金融租赁Euroequipement S.A.公司总裁助理，富通银行区域经理、大中华地区主管，富通基金管理亚洲有限公司投资经理、业务发展部总经理、首席执行官。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事、总经理。

张文伟先生，董事、副总经理，硕士，高级经济师。历任交通银行郑州分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长，海通证券办公室主任，海通证券投资银行总部副总经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事、副总经理。

郑国汉先生，独立董事，经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济系副教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长，现任商学院院长及经济系讲座教授。

巴约特（Marc Bayot）先生，独立董事，比利时籍，布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学经济学荣誉教授，Pionner投资公司独立副董事长、Fundconnect独立董事长、Degroof资产管理公司独立董事和法国巴黎银行B Flexible SICAV 独立董事。

杨国平先生，独立董事，硕士，高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记，上海市公用事业管理局党办副主任，上海市出租汽车公司党委书记，现任大众交通（集团）股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用事业（集团）股份有限公司董事长、上海交大昂立股份有限公司董事长。

王明权先生，独立董事，硕士，高级经济师。历任武汉市人民政府副市长、交通银行行长、党委（组）书记、副董事长、中国光大（集团）总公司董事长、党委书记。现任全国人大代表、全国人大财经委员会委员。

李础前先生，监事长，经济学硕士，高级经济师。历任安徽省财政厅中企处副主任科员，安徽省国有资产管理局科长，海通证券计划财务部副总经理、总经理和财务总监。

余毓繁先生，监事，英国籍，工商管理荣誉学士。历任比利时通用银行香港分行资金部司库、富通银行亚洲区环球金融市场业务主管、富通银行亚洲区商人银行董事总经理，富通银行香港分行行政总裁。

奚万荣先生，监事，经济学硕士。中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管、海通证券股份有限公司监察稽核部稽核员。2003年4月至今任海富通基金管理有限公司稽核经理、监察稽核总监。

章明女士，督察长，硕士。历任加拿大BBCC Tech & Trade Int'l Inc 公司高级财务经理、加拿大Future Electronics 公司产品专家，国信证券业务经理和副高级研究员，海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003 年至今任海富通基金管理有限公司督察长。

陈洪先生，副总经理兼投资总监，硕士。历任君安证券有限公司投资经理、广东发展银行深圳分行业务经理、富通基金管理亚洲有限公司基金经理。2003年4月至今任海富通基金管理有限公司投资总监兼海富通精选混合基金基金经理，2005年7月至2006年9月任海富通股票基金基金经理，2006年3月至9月任海富通收益增长混合基金基金经理，2006年5月起，任海富通基金管理有限公司副总经理，2007年2月至2007年8月任海富通风格优势股票基金基金经理，2007年4月至2007年8月任海富通精选贰号混合基金基金经理，2008年6月至2011年2月任海富通中国海外股票（QDII）基金基金经理。

阎小庆先生，副总经理，硕士。历任中国人民银行上海分行助理经济师、富通银行欧洲管理实习生、法国东方汇理银行市场部副经理、法国农业信贷银行上海华东区首席代表、富通基金管理公司上海代表处首席代表、海富通基金管理有限公司市场总监，2006年5月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

刘璎女士，硕士。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。2012年1月起兼任海富通中证100指数证券投资基金（LOF）基金经理。

本基金历任基金经理为蒋征先生，任职时间为2010年9月至2012年1月。

投资决策委员会常设委员有：田仁灿，总经理；陈洪，副总经理兼投资总监；戴德舜，股票绝对收益组合部总监；蒋征，股票相对收益组合部总监；丁俊，研究总监；邵佳民，固定收益组合管理部总监；杜晓海，定量及风险管理总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### 二、基金托管人

（一）基金托管人的基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间：1984年1月1日
法定代表人：姜建清
注册资本：人民币349,018,545,827元
联系电话：010-66105799
联系人：赵会军

### 三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、申购赎回代理券商（简称"一级交易商"）

1）海通证券股份有限公司
地址：上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人：王开国
客户服务电话：021-95553或4008888001
联系人：李笑鸣
网址：www.htsec.com

2）国信证券股份有限公司
地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层到26层
法定代表人：何如
客户服务电话：95536
联系人：齐晓燕
网址：www.guosen.com.cn

3）光大证券股份有限公司
地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：徐浩明
客户服务电话：400-8888-788
联系人：刘晨、李芳芳
网址：www.ebscn.com

4）财富证券有限责任公司
地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
法定代表人：周晖
电话：0731-84403360
传真：0731-84403330
联系人：朱友谊
网址：www.cfzq.com

5）齐鲁证券有限公司
地址：山东省济南市经七路86 号
法定代表人：李玮
客户服务电话：95538
联系人：王霖
网址：www.qlzq.com.cn

6）国元证券股份有限公司
地址：安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人：凤良志
客户服务电话：0551-96888
联系人：陈琳琳
网址：www.gyzq.com.cn

7）长城证券有限责任公司
地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
客户服务电话：4006666888
联系人：李春芳
网址：www.cgws.com

8）平安证券有限责任公司
地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人：杨宇翔
客户服务电话：95511转8
联系人：郑舒丽
网址：www.pingan.com

9）广州证券有限责任公司
地址：广州市越秀区先烈中路69号东山广场主楼17楼
法定代表人：刘东
客户服务电话：020-961303
联系人：林洁茹
网址：www.gzs.com.cn

10）东兴证券有限责任公司
地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人：徐勇力
客户服务电话：4008-888-993
联系人：汤漫川
网址：www.dxzq.net

11）德邦证券有限责任公司
住所：上海市福山路500号城建国际中心26层
法定代表人：姚文平
客户服务电话：4008888128
联系人：罗芳
网址：www.tebon.com.cn

12）东方证券股份有限公司
地址：上海市中山南路318号2号楼21层-29层
法定代表人：潘鑫军
客户服务电话：95503
联系人：吴宇
网址：www.dfzq.com.cn

13）上海证券有限责任公司
地址：上海市黄浦区西藏中路336号
法定代表人：郁忠民
客户服务电话：4008 918 918
联系人：陈翔
网址：www.962518.com

14）江海证券有限公司
办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
联系人：高悦铭
客服电话：400-666-2288
公司网站：www.jhzq.com.cn

15）招商证券股份有限公司
地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人：宫少林
客户服务电话：400-8888-111或95565
联系人：林生迎
网址：www.newone.com.cn

16）山西证券股份有限公司
地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：侯巍
客户服务电话：400-666-1618
联系人：张志国
网址：www.i618.com.cn

17）红塔证券股份有限公司
地址：云南省昆明市北京路155号附一号红塔大厦9楼
法定代表人：况雨林
客户服务电话：0871 – 3577888
联系人：刘晓明
网址：www.hongtastock.com

18）广发证券股份有限公司
地址：广东省广州市天河北路183号大都会广场43楼
法定代表人：林治海
广发证券客服电话：95575
联系人：黄岚
网站：www.gf.com.cn

2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

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，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：金颖
电话：010-59378835
传真：010-59378907
联系人：刘永卫

（三）出具法律意见书的律师事务所

通力律师事务所
地址：上海市银城中路68号 时代金融中心19楼
负责人：韩炯
电话：021-31358666
传真：021-3135 8600
联系人：黎明
联系电话：021-31358666-8663
经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所

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：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法人代表：杨绍信
经办注册会计师：汪棣、刘莉
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：刘莉

### 四、基金的名称

本基金的名称：上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金

### 五、基金的类型

基金类型：股票型、交易型开放式

### 六、基金的投资目标

本基金的投资目标为：紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。

### 七、投资方向和范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 八、基金的投资策略

本基金采用完全复制法跟踪标的指数，按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，进行被动式指数化投资，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金经理可以对投资组合进行适当变通和调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

1、决策依据

有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责制定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理负责日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

3、投资程序

研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估及组合维护等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

（1）研究支持：定量研究团队依托基金管理人整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果，开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策：投资决策委员会依据定量研究团队提供的研究报告，定期或遇重大事项时召开投资决策会议，决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

（3）组合构建：根据标的指数情况，结合研究支持，基金经理以完全复制标的指数成份股及成分股权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，降低买入成本、控制投资风险。

（4）交易执行：交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

（5）投资绩效评估：定量研究团队定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检视投资策略，进而调整投资组合。

（6）组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理体制和程序做出调整，并在基金招募说明书中列示。

4.构建投资组合

构建本基金投资组合的过程主要分为三步：确定目标组合、确定建仓策略和逐步调整。

（1）确定目标组合：基金管理人根据完全复制的原则确定目标组合，其投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，在特殊情况下，需要选择其他股票进行替代的，本基金按照合理方法来选择替代股票。

（2）确定建仓策略：基金经理根据对成份股流动性、公司基本面等因素的分析，确定合理的建仓策略。

（3）逐步调整：确定目标组合及建仓策略后，基金经理在规定时间内采用适当的方法构建和调整实际组合直至达到跟踪指数要求。

5.日常投资组合管理

（1）标的指数成份股日常跟踪

当成份股发生增发、配股、分红等情况或其他可能会影响成份股在指数中权重的行为时，基金管理人将分析这些信息对指数的影响，进而进行组合调整分析，及时调整股票投资组合。

（2）标的指数的跟踪与分析

如果出现标的指数成分股临时调整、编制方法调整或其他可能影响组合跟踪效果的情形，基金管理人将分析调整对所跟踪标的指数的影响，并及时制定相应的投资组合调整策略。

（3）申购赎回调整

跟踪本基金申购和赎回信息，分析其对组合的影响。

（4）投资组合的调整：利用数量化分析等方法，寻找将实际组合调整到目标组合的最优方案，确定组合调整及交易策略。

（5）制作并公布申购、赎回清单：以T-1日指数成份股构成及其权重为基础，根据上市公司公告，考虑T日可能发生的上市公司变动情况，设计T日的申购赎回清单并公告。

6、定期投资组合管理

基金管理人将定期进行投资组合管理，主要完成下列事项：

（1）本基金股票组合将根据标的指数的编制规则、备选股票的预期及调整公告，对股票投资组合及时进行调整。

（2）定期分析基金与标的指数表现的偏离，并对跟踪误差等进行分析，确定跟踪误差来源，优化指数跟踪方案。

（3）根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求，及时检查组合中现金的比例，进行定期支付现金的准备。

7、投资绩效评估

（1）每日对基金的绩效评估进行，分析基金跟踪偏离度；

（2）每月末，定量研究团队对本基金的运行情况进行量化评估；

（3）每月末，基金经理根据评估报告分析本基金的偏离度和跟踪误差产生原因、现金的控制情况、标的指数调整成份股前后的操作、以及成分股未来成份股的变化等。

建仓期结束后，在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%，年跟踪误差不超过2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

### 九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为上证周期行业50指数。

如果指数编制单位变更或停止上证周期行业50指数的编制及发布、或上证周期行业50指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致上证周期行业50指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，履行适当程序后，变更本基金的标的指数。

### 十、基金的风险收益特征

本基金属股票型基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年4月16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。

本投资组合报告所载数据截止至2011年12月31日（"报告期末"）。

1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 366,642,533.47 | 95.79 |
|  | 其中：股票 | 366,642,533.47 | 95.79 |
| 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 | 16,122,478.32 | 4.21 |
| 6 | 其他各项资产 | 6,494.00 | 0.00 |
| 7 | 合计 | 382,771,505.79 | 100.00 |

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | – | – |
| B | 采掘业 | 65,851,389.10 | 17.46 |
| C | 制造业 | 25,525,202.07 | 6.77 |
| C0 | 食品、饮料 | – | – |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | – | – |
| C2 | 木材、家具 | – | – |
| C3 | 造纸、印刷 | – | – |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | – | – |
| C5 | 电子 | – | – |
| C6 | 金属、非金属 | 25,525,202.07 | 6.77 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | – | – |
| C8 | 医药、生物制品 | – | – |
| C99 | 其他制造业 | – | – |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | – | – |
| E | 建筑业 | – | – |
| F | 交通运输、仓储业 | 14,522,795.14 | 3.85 |
| G | 信息技术业 | – | – |
| H | 批发和零售贸易 | – | – |
| I | 金融、保险业 | 244,249,434.79 | 64.74 |
| J | 房地产业 | 16,493,712.37 | 4.37 |
| K | 社会服务业 | – | – |
| L | 传播与文化产业 | – | – |
| M | 综合类 | – | – |
|  | 合计 | 366,642,533.47 | 97.19 |

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 2,399,743 | 28,484,949.41 | 7.55 |
| 2 | 600016 | 民生银行 | 4,528,987 | 26,675,733.43 | 7.07 |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 2,595,989 | 25,207,053.19 | 6.68 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 628,671 | 21,651,429.24 | 5.74 |
| 5 | 601328 | 交通银行 | 4,370,748 | 19,580,951.04 | 5.19 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 1,513,758 | 18,952,250.16 | 5.02 |
| 7 | 600000 | 浦发银行 | 2,144,062 | 18,203,086.38 | 4.83 |
| 8 | 601939 | 建设银行 | 3,683,934 | 16,725,060.36 | 4.43 |
| 9 | 601088 | 中国神华 | 631,096 | 15,985,661.68 | 4.24 |
| 10 | 601601 | 中国太保 | 613,172 | 11,779,034.12 | 3.12 |

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

8.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

8.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | – |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,072.70 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 3,421.30 |
| 5 | 应收申购款 | – |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 6,494.00 |

8.4 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。

8.5 报告期末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。

### 十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2011年12月31日。

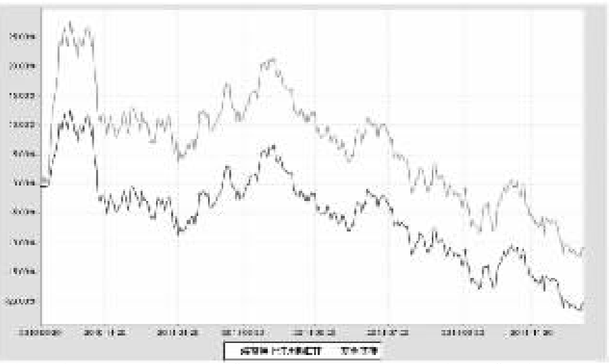
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

| 阶段 | 净值增长率（1） | 净值增长率标准差（2） | 业绩比较基准收益率（3） | 业绩比较基准收益率标准差（4） | （1）-（3） | （2）-（4） |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2010年9月19日至2010年12月31日 | -4.20% | 1.61% | 9.02% | 1.88% | -13.22% | -0.27% |
| 2011年1月1日至2011年12月31日 | -16.96% | 1.29% | -18.32% | 1.34% | 1.36% | -0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | -20.42% | 1.36% | -10.96% | 1.47% | -9.46% | -0.11% |

（二）本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：

（2010年9月19日 至2011年12月31日）



注：按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起三个月。截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同第十三章（二）投资范围、（六）投资限制中规定的各项比例。

### 十三、 基金的费用和税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、基金标的指数许可使用费；
4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
6、基金份额持有人大会费用；
7、基金上市费及年费；
8、基金的证券交易费用；
9、基金的银行汇划费用；
10、基金收益分配中发生的费用；
11、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.5%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.1%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、标的指数许可使用费

在通常情况下，基金标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H=E×标的指数许可使用费年费率÷当年天数，根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，本基金标的指数许可使用费年费率为0.03%

H为每日应计提的基金标的指数许可使用费
E为前一日基金资产净值

自基金合同生效之日起，基金标的指数许可使用费每日计提，按季支付。根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币50,000元，当季标的指数许可使用费不足50,000元的，按照50,000元支付。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年1月，4月，7月，10月首日起10个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

上述"一、基金费用的种类"中第4-11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3、基金合同生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

### 十四、对招募说明书更新部分的说明

上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

一、"二、释义"部分，更新了关于《销售办法》的释义。

二、"第三节 基金管理人"部分：

1、更新了艾德加（Stewart Edgar）先生、郑国汉先生、巴约特（Marc Bayot）先生、杨国平先生、王明权先生、李础前先生、余毓繁先生、阎小庆先生以及刘璎女士的简历；

2、删除了蒋征先生的简历，并对历任基金经理的信息进行了更新；

3、更新了投资决策委员会常设委员的相关信息。

三、"四、基金托管人"部分，更新了基金托管人的证券投资基金托管情况。

四、"五、相关服务机构" 部分：更新了会计师事务所的经办注册会计师及联系人信息。

五、"第十节 基金份额的申购与赎回"部分，更新了申购赎回清单的格式举例。

六、"第十一节 基金的投资"和"第十二节 基金的业绩"部分，根据2011年第四季度报告，更新了基金投资组合报告和基金业绩的内容，相关数据截止期为2011年12月31日。

**海富通基金管理有限公司**
**2012年5月2日**

---

**股票简称：万向钱潮　　股票代码：000559　　公告编号：2012-025**

## 万向钱潮股份有限公司2012年公司债券发行结果公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在虚假记载、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。

根据《万向钱潮股份有限公司2012年公司债券发行公告》，万向钱潮股份有限公司2012年公司债券(以下简称"本期债券")发行总额为人民币15亿元，发行价格为每张100元，采取网上面向社会公众投资者公开发行和网下面向机构投资者询价配售相结合的方式发行。

本次债券发行工作已于2012年4月27日结束，发行总额为人民币15亿元，具体发行情况如下：

1、网上发行

本期债券网上预设的发行数量占本期债券发行规模的比例为0.67%，即人民币0.1亿元。最终网上实际发行数量为0.1亿元，占本期债券发行总量的0.67%。

2、网下发行

本期债券网下预设的发行数量占本期债券发行规模的比例为99.33%，即人民币14.9亿元。最终网下实际发行数量为14.9亿元，占本期债券实际发行总量的99.33%。

特此公告。

**发行人：万向钱潮股份有限公司**
**保荐人（主承销商）：中国银河证券股份有限公司**
**2012年5年2日**

---

**证券代码：002009　　证券简称：天奇股份　　公告编号：2012-023**

## 江苏天奇物流系统工程股份有限公司重要合同公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

一、合同主要内容

本公司于2012年4月27日收到东风汽车有限公司东风日产乘用车公司的通知，本公司中标该公司郑州工厂总装输送设备-ZZ70JPH(主线1包+2包）工程，项目合同总价为6945万元。合同竣工期为：2013年7月。 根据约定：双方将在期后正式签订商务合同与技术协议。

二、交易对方情况介绍

东风汽车有限公司东风日产乘用车公司，成立于2003年6月16日，是东风汽车有限公司旗下重要的乘用车板块，从事乘用车的研发、采购、制造、销售、服务业务，是国内为数不多的具备全价值链的汽车生产企业。

东风日产乘用车公司由花都工厂、襄樊工厂、发动机分公司以及研发中心组成，有员工7000余人。

东风日产花都、襄樊两工厂年总生产能力达46万辆，产品品质和生产效率比肩国际先进水平。目前，东风日产旗下拥有新一代天籁、奇骏、逍客、轩逸、骐达、颐达、骏逸、骊威等多款畅销车型，完成了五大车系的战略布局，覆盖轿车、MPV、SUV、CROSS-OVER等领域，成为行业内车型最多，产品线最完整的企业之一。

东风汽车有限公司东风日产乘用车公司与本公司不存在关联关系。

东风汽车有限公司东风日产乘用车公司上一会计年度（2011年度）与本公司发生的类似业务交易金额为9387万元。

作为东风、日产全面合作的中国汽车业最大的合资公司之一，东风汽车有限公司东风日产乘用车公司具有强大的经济实力，公司信誉好，交易履约风险较小。

三、项目履行对公司的影响和风险提示

本项目合同金额占公司最近一个会计年度（2011年）营业总收入的4.50%。本项目竣工时间为2013年7月，主要对公司2012、2013年利润产生积极影响。

因本项目合同执行存在一定的周期，项目采购成本会受市场影响发生一定程度的波动，从而影响项目利润，存在一定的风险。

特此公告。

**江苏天奇物流系统工程股份有限公司董事会**
**2012年5月2日**

---

**证券代码：002266　　证券简称：浙富股份　　公告编号：2012-019**

## 浙江富春江水电设备股份有限公司关于董事短线买卖本公司股票的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，对公告的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏负连带责任。

本公司获悉，公司董事宗佩民先生于2012年1月19日买入公司股票22300股，买入均价13.30元/股，其后又于2012年4月26日将该部分股票全部卖出，卖出均价17.78元/股，获益99904元（不含交易费）。

经公司董事会核查，宗佩民先生此次买卖股票交易行为属于六个月内的双向操作，违反了《证券法》第四十七条及深圳证券交易所《上市公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理业务指引》的规定。同时，董事会查询了宗佩民先生近六个月内买卖公司股票的情况，未发现其他短线交易行为。宗佩民先生承诺六个月内不再买卖本公司股票。

公司董事会向宗佩民先生进一步说明了有关买卖本公司股票的规定，并要求其严格规范买卖公司股票的行为，审慎操作；同时，董事会对其本次短线交易的全部收益予以没收；此外，董事会向全体董事、监事和高级管理人员对宗佩民先生的违规行为予以了通报，并要求引以为戒。

公司今后将进一步加强董事、监事、高级管理人员和主要股东对相关法律法规知识的培训和学习，督促相关人员严格遵守有关规定，避免此类事件的再次发生。

特此公告。

**浙江富春江水电设备股份有限公司董事会**
**二〇一二年四月二十八日**

---

## 关于招商标普金砖四国指数证券投资基金（LOF）2012年境外主要市场节假日暂停申购赎回和定投申购业务的公告

**公告送出日期：2012年5月2日**

1 公告基本信息

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | | 招商标普金砖四国指数证券投资基金（LOF） |
| 基金简称 | | 招商标普金砖四国指数（QDII-LOF） |
| 场内简称 | | 招商金砖 |
| 基金主代码 | | 161714 |
| 基金管理人名称 | | 招商基金管理有限公司 |
| 公告依据 | | 根据《招商标普金砖四国指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《招商标普金砖四国指数证券投资基金（LOF）招募说明书》的相关规定 |
| 暂停相关业务的起始日、金额及原因说明 | 暂停申购起始日 | 2012年5月7日 |
| | 暂停大额申购起始日 | – |
| | 暂停转换转入起始日 | – |
| | 暂停大额转换转入起始日 | – |
| | 暂停赎回起始日 | 2012年5月7日 |
| | 暂停转换转出起始日 | – |
| | 暂停定期定额投资起始日 | 2012年5月7日 |
| | 限制申购金额（单位：人民币元） | – |
| | 限制转换转入金额（单位：人民币元） | – |
| | 暂停（大额）申购（转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资）的原因说明 | 因境外主要市场逢节假日暂停交易，同时为了保障基金平稳运作，保护基金持有人利益 |

注：-

2 其他需要提示的事项

招商基金管理有限公司（以下简称"本公司"）决定，于2012年5月7日（银行假日）暂停招商标普金砖四国指数证券投资基金（LOF）（以下简称"本基金"，基金代码：161714）的申购、赎回和定期定额申购业务，并于2012年5月8日恢复，届时将不再另行公告。暂停期间投资人提交的本基金的申购、赎回及定期定额申购业务本公司将不予确认。

若境外主要市场节假日或交易清算日发生变化，或根据法律法规和基金合同的约定，本基金需要调整申购、赎回等业务安排的，本公司将另行公告。

敬请广大投资者认真查阅直销机构和各代销机构的具体业务规则，及早做好交易安排，避免因境外主要市场节假日原因带来不便。

如有疑问，请拨打客户服务热线：400-887-9555（免长话费），或登陆网站www.cmfchina.com获取相关信息。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读基金合同、招募说明书等文件。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

**招商基金管理有限公司**
**2012年5月2日**

---

**证券代码：000948　　证券简称：南天信息　　公告编号：2012-017**

## 云南南天电子信息产业股份有限公司临时停牌公告

本公司及其董事保证信息披露内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

由于南天信息拟实施非公开发行股票方案，为避免公司股价异常波动，充分保护广大投资者的利益，我公司特申请2012年5月2日公司股票停牌。2012年5月3日公司将及时刊登相关公告并复牌。

特此公告！

**云南南天电子信息产业股份有限公司董事会**
**二〇一二年四月二十七日**

---

**证券代码：600401　　证券简称：ST申龙　　公告编号：临2012-037**

## 海润光伏科技股份有限公司重大事项停牌公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实、准确和完整承担个别及连带责任。

因本公司正在拟议筹划非公开发行股票事宜，为维护投资者利益，保证公平信息披露，经公司申请，本公司股票自2012年5月2日起停牌。公司将尽快确定是否进行前述重大事宜，并于股票停牌之日起的5个工作日内公告。

公司指定的信息披露报刊为《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》。公司将严格按照有关法律法规的规定和要求，及时做好信息披露工作，敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

**海润光伏科技股份有限公司**
**董事会**
**2012年5月2日**

---

**证券代码：600066　　证券简称：宇通客车　　编号：临2012-032**

## 郑州宇通客车股份有限公司停牌公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

郑州宇通客车股份有限公司（以下简称"公司"）正在筹划股权激励计划，拟于2012年5月2日召开董事会审议前述计划。为避免公司股票二级市场股价波动，保护投资者利益，经公司向上海证券交易所申请，公司股票于2012年5月2日开市起停牌，待有关事项确定后，公司将尽快履行信息披露义务。公司股票最迟于2012年5月3日开市起复牌。敬请广大投资者注意风险。

特此公告。

**郑州宇通客车股份有限公司董事会**
**二零一二年四月二十七日**

---

**证券代码：601179　　股票简称：中国西电　　编号：临2012-011**

## 中国西电电气股份有限公司重大事项进展公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

日前，中国西电电气股份有限公司（下称"公司"）因筹划引进战略投资者事宜，公司股票已按有关规定停牌。公司与战略投资者就其战略入股和开展战略合作事宜正进行协商。因相关方案尚需论证，公司股票将继续停牌，公司董事会承诺公司股票将于五个交易日内复牌并公告相关进展情况。

特此公告。

**中国西电电气股份有限公司**
**董事会**
**2012年04月27日**