海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新招募说明书摘要

(2012 年第 2 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

海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称"本基金")经 2011 年 2 月 23 日中国证券监督管理委员会证监许可【2011】268 号文核准募集。本基金的基金合同于 2011 年 4 月 27 日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

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:因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金投资债券引发的信用风险,以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金为 ETF 联接基金,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,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,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 10 月 27 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2012 年 9 月 30 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,美国籍,学士,历任美国 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,美国 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。

李疆前先生,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。

谷若鸿(Mr. Laurent couraudon)先生,法国籍,国际贸易硕士,历任法国巴黎银行瑞士日内瓦分行商品及贸易融资部高级客户经理,法国巴黎银行莫斯科代表处能源及商品融资首席代表,法国外贸银行莫斯科分行董事及企业金融部主管,法国巴黎银行俄罗斯分行业务拓展主管,法国巴黎银行莫斯科分行首席执行官兼俄罗斯区总裁,现任法国巴黎银行(中国)有限公司董事会主席兼中国区总裁。

戴万荣先生,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,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 月至今任海富通精选混合基金经理,2003 年 4 月至 2012 年 9 月任海富通基金管理有限公司投资总监,2005 年 7 月至 2006 年 9 月任海富通股票基金经理,2006 年 3 月至 9 月任海富通收益增长混合基金经理,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经理,2007 年 4 月至 2007 年 8 月任海富通精选贰号混合基金经理,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 基金经理助理;2007 年 3 月至 2010 年 6 月担任华安上证 180ETF 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 及海富通上证周期 ETF 联接基金经理,2011 年 4 月起兼任海富通上证非周期 ETF 及海富通上证非周期 ETF 联接基金经理,2012 年 1 月起任海富通中证 100 指数(LOF)基金经理,2012 年 5 月起兼任海富通中证内地低碳指数基金经理。

投资决策委员会常设委员有:田仁灿,总经理;陈洪,副总经理;戴德舜,投资总监;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.直销机构

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
全国统一客户服务号码:40088-40099(免长途话费)
电话:021-38650797
传真:021-33830160

2.场外代销机构

(1)中国工商银行股份有限公司
地址:北京市西城区复兴门内大街 55 号(100032)
法定代表人:姜建清
客户服务电话:95588
电话:010-66107900
传真:010-66107914
网址:www.icbc.com.cn

(2)中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街 25 号
办公地址:北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
法定代表人:王洪章
传真:010-66275654
客户服务电话:95533
联系人:张静
网址:www.ccb.com

(3)中国银行股份有限公司
地址:北京市西城区复兴门内大街 1 号
法定代表人:肖钢
电话:010-66596688
传真:010-66593777
客户服务电话:95566
网址:www.boc.cn

(4)交通银行股份有限公司
地址:上海市银城中路 188 号
法定代表人:胡怀邦
客户服务电话:95559
联系人:曹榕
网址:www.bankcomm.com

(5)招商银行股份有限公司
地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
法定代表人:傅育宁
客户服务电话:95555
联系人:邓炯鹏
网址:www.cmbchina.com

(6)平安银行股份有限公司
地址:广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦
法定代表人:孙建一
客户服务电话:95511-3
开放式基金业务传真:0755-25879453
联系人:周晓霞
网址:www.bank.pingan.com

(7)上海浦东发展银行股份有限公司
地址:上海市中山东一路 12 号
法定代表人:吉晓辉
客户服务电话:95528
联系人:徐伟、冯嘉惠
网址:www.spdb.com.cn

(8)中国民生银行股份有限公司
地址:北京市西城区复兴门内大街 2 号
法定代表人:董文标
客户服务电话:95568
联系人:董云巍
网址:www.cmbc.com.cn

(9)华夏银行股份有限公司
地址:北京市东城区建国门内大街 22 号
法定代表人:吴建
客户服务电话:95577
网址:www.hxb.com.cn

(10)中国农业银行股份有限公司
地址:北京市东城区建国门内大街 69 号
法定代表人:蒋超良
客户服务电话:95599
传真:010-85108557
网址:www.abchina.com

(11)中信银行股份有限公司
地址:北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座
法定代表人:田国立
客户服务电话:95558
联系人:赵树林
网址:www.ecitic.com/bank

(12)浙商银行股份有限公司
地址:中国杭州市庆春路 288 号
法定代表人:张达洋
客户服务电话:95527
联系人:毛真海
网址:www.czbank.com

(13)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

(14)国泰君安证券股份有限公司
地址:上海市浦东新区商城路 618 号
法定代表人:万建华
客户服务电话:95521
联系人:芮敏祺、吴倩
网址:www.gtja.com

(15)安信证券股份有限公司
地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 楼
法定代表人:牛冠兴
客户服务电话:400-800-1001
联系人:陈剑虹
网址:www.essence.com.cn

(16)渤海证券股份有限公司
地址:天津市南开区宾水西道 8 号
法定代表人:杜庆平
客户服务电话:400-651-5988
联系人:王兆权
网址:www.ewww.com.cn

(17)财富证券有限责任公司
地址:湖南长沙芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26-28 层
法定代表人:周晖
电话:0731-84403360
联系人:朱友谊
网址:www.cfzq.com

(18)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:高峰
网址:www.cgws.com

(19)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

(20)第一创业证券股份有限公司
地址:广东省深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层
法定代表人:刘学民
客户服务电话:4008881888
联系人:魏颖
网址:http://www.fcsc.com

(21)东北证券股份有限公司
地址:吉林省长春市自由大路 1138 号
法定代表人:矫正中
客户服务电话:4006000686
联系人:潘衍
网址:www.nesc.cn

(22)东莞证券有限责任公司
地址:广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼
法定代表人:张棉辉
客户服务电话:961130(省内直拨,省外请在前加拨区号 0769)
联系人:梁建伟
网址:www.dgzq.com.cn

(23)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:95525
联系人:刘晨、李芳芳
网址:www.ebscn.com

(24)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

(25)国都证券有限责任公司
地址:北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层、10 层
法定代表人:常喆
客户服务电话:400-818-8118
联系人:黄静
网址:www.guodu.com

(26)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

(27)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:蔡咏
客户服务电话:95578
联系人:陈琳琳
网址:www.gyzq.com.cn

(28)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 - 3577942
联系人:刘晓明
网址:www.hongtastock.com

(29)宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号
办公地址:北京市西城区太平桥大街 19 号
法定代表人:冯戎
客户服务电话:4008-000-562
联系人:李巍
网址:www.hysec.com

(30)华龙证券有限责任公司
地址:甘肃省兰州市东岗西路 638 号
法定代表人:李晓安
客户服务电话:4006898888
联系人:李昕田
网址:http://www.hlzqgs.com

(31)华泰联合证券有限责任公司
地址:深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 25、24、10 层
法定代表人:马昭明
客户服务电话: 95513
联系人:盛宗凌
网址:www.lhzq.com

(32)江海证券有限公司
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
网址:www.jhzq.com.cn

(33)民生证券有限责任公司
地址:北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 层 16-18 层
法定代表人:余政
客户服务电话:4006198888
联系人:赵明
网址:http://www.mszq.com/

(34)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:stock.pingan.com

(35)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:孙鋆志
网址:www.qlzq.com.cn

(36)日信证券有限责任公司
地址:呼和浩特市新城区锡林南路 18 号
法定代表人:孔伯杰
客户服务电话:010-88086830
联系人:冯杰
网址: www.rxzq.com.cn

(37)山西证券股份有限公司
地址:山西省太原市府西街 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:张治国
网址:www.i618.com.cn

(38)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:4008918918,021-962518
联系人:陈翔
网址:www.962518.com

(39)申银万国证券股份有限公司
地址: 上海市常熟路 171 号
法定代表人:储晓明
客户服务电话:95523
联系人:高夫
网址:www.sywg.com.cn

(40)中国银河证券股份有限公司
地址:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
法定代表人:陈有安
客户服务电话:4008-888-888
联系人:田薇
网址:www.chinastock.com.cn

(41)英大证券有限责任公司
地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
法定代表人:赵文宏
客户服务电话:4008698698
联系人:李欣
网址: www.ydsc.com.cn

(42)中国国际金融有限公司
地址:北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
法定代表人:李剑阁
公司总机:010-65051166(北京);021-58796226(上海)
联系人:易建军
网址:www.cicc.com.cn

(43)中山证券有限责任公司
地址: 深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层
法定代表人: 吴永良
客户服务电话: 4001022011
联系人: 李玲
网址:www.zszq.com.cn

(44)中国中投证券有限责任公司
地址:深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 18 层至 21 层
法定代表人:龙增来
客户服务电话:95532 或 4006008008
联系人:刘毅
网址:http://www.china-invs.cn/

(45)中信建投证券股份有限公司
地址:北京市朝阳门内大街 188 号
法定代表人:王常青
客户服务电话: 400-8888-108
联系人:权唐
网址:www.csc108.com

(46)中信证券股份有限公司
地址:北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦
法定代表人:王东明
电话:95558
联系人:陈忠
网址:www.cs.ecitic.com

(47)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: 95565
联系人:林生迎
网址:www.newone.com.cn

(48)华泰证券股份有限公司
地址:江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
客户服务电话:95597
联系人:肖亦玲
网址:www.htsc.com.cn

(49)长江证券股份有限公司
地址:武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
客户服务电话:95579
联系人:李良
长江证券客户服务网站:www.95579.com

(50)中信证券(浙江)有限责任公司
地址:浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层
法定代表人:沈强
客户服务电话:0571-96598
联系人:俞会亮
网址:www.bigsun.com.cn

(51)中信万通证券有限责任公司
地址:青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层
法定代表人:杨宝林
客户服务电话:0532-96577
联系人:吴忠超
网址:www.zxwt.com.cn

(52)广发证券股份有限公司
法定代表人:孙树明
注册地址:广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼(4301-4316 房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼
联系人:黄岚
统一客户服务热线:95575 或致电各地营业网点
公司网站:www.gf.com.cn

(53)中航证券有限公司
地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼
法定代表人:杜航
电话:4008866567
联系人:戴蕾
网址:www.scstock.com

(54)中国民族证券有限责任公司
地址:北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6 层-9 层
法定代表人:赵大建
客户服务电话:400-889-5618
联系人:李微
网址:www.e5618.com

(55)华宝证券有限责任公司
地址:上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 57 楼
法定代表人:陈林
客户服务电话:4008209898
联系人:刘闻川
网址:www.cnhbstock.com

(56)信达证券股份有限公司
地址:北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼
法定代表人:高冠江
客户服务电话:400-800-8899
联系人:唐静
网址:www.cindasc.com

(57)华福证券有限责任公司
地址:福州五四路新天地大厦 7 至 10 层
法定代表人:黄金琳
客户服务电话:0591-96326
联系人:张腾
网址:www.gfhfzq.com.cn

(58)东兴证券股份有限公司
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:崔海涛
客户服务电话:4008-888-993
联系人:黄英
网址:www.dxzq.net

(59)天相投资顾问有限公司
地址:北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701
法定代表人:林义相
客户服务电话:010-66045678
联系人:林爽
网址:www.txsec.com

(60)深圳众禄基金销售有限公司
地址:深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元
法定代表人:薛峰
客户服务电话:4006-788-887
联系人:张玉静
网址:www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

(61)杭州数米基金销售有限公司
地址:浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼
法定代表人:陈柏青
客户服务电话:4000-766-123
联系人:周晓荣
网址:www.fund123.cn

(62)上海好买基金销售有限公司
地址:上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室
法定代表人:杨文斌
客户服务电话:400-700-9665
联系人:唐眉
网址:www.ehowbuy.com

(63)上海长量基金销售投资顾问有限公司
地址:上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
法定代表人:张跃伟
客户服务电话:400-089-1289
联系人:张裕
网址:www.erichfund.com

3.场内销售机构

具有开放式基金代销资格的、经中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员可成为本基金的场内销售机构,相关信息同时通过上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)登载。

基金管理人可以根据需要,增加其他符合要求的机构代理销售本基金,并按照相关规定及时公告。

(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
办公地址: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:任瑞新

(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:021-31358600
联系人:王利民
经办律师:秦悦民、王利民

(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、金毅
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:海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

五、基金的类型

基金类型:股票型、契约型开放式

六、基金的投资目标

通过投资于上证非周期行业 100ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。

七、基金的投资方向和范围

本基金投资于上证非周期行业 100ETF、上证非周期行业 100 指数成份股和备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。其中投资于上证非周期行业 100ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,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

本基金通过主要投资于上证非周期行业 100ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数表现、建仓完成后,正常情况下投资于上证非周期行业 100ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。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 0.3%,年跟踪误差不超过 4%。在目标 ETF 日均跟踪偏离度符合其基金合同所设定目标的前提下,如因指数编制规则调整等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,避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

本基金投资于上证非周期行业 100ETF 的方式以申购和赎回为主,但在上证非周期行业 100ETF 二级市场流动性较好的情况下,也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF。

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、目标 ETF 二级市场的流动性和折溢价分析、成分股流动性分析、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,基金经理构建以目标 ETF 为主的投资组合。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:基金经理将跟踪目标 ETF 及标的指数变动,结合成份股基本面情况、成分股及目标 ETF 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.投资组合管理

1)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:基金管理人通过主要投资于目标 ETF 及标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资,以紧密跟踪标的指数的表现,通常情况下,投资于上证非周期行业 100ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%。

(2)确定建仓策略:基金经理根据对成份股流动性、目标 ETF 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。

2)日常投资组合管理

(1)对目标 ETF 二级市场流动性及折溢价进行跟踪与分析,制订目标 ETF 份额的申购赎回、二级市场买卖策略。

(2)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。

(3)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。

(4)申购赎回调整

本基金将根据本基金的申购和赎回情况,结合基金的现金头寸管理,对投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数。

(5)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。

3)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)本基金投资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,分析并制定投资组合调整策略,尽量减少因成份股变动所带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

(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。

4)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。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:上证非周期行业 100 指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%

如果目标 ETF 变更业绩比较基准、或上证非周期行业 100 指数的编制单位变更或停止上证非周期行业 100 指数的编制及发布、或上证非周期行业 100 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非周期行业 100 指数不宜继续作为业绩比较基准的组成部分,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出,或目标 ETF 标的指数发生变更,基金管理人认为有必要作相应调整时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在履行适当程序后,变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属 ETF 联接基金,属于高风险、高预期收益的投资品种。同时本基金为上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金的联接基金,具有与上证非周期行业 100 指数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 11 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。

本投资组合报告所载数据截止至 2012 年 9 月 30 日("报告期末")。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	154,837,520.02	94.83
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,434,125.70	5.17
7	其他各项资产	9,965.60	0.01
8	合计	163,281,611.32	100.00

2.期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	海富通基金管理有限公司	154,837,520.02	94.98

3、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

4.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

本基金本报告期末未持有股票。

5、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。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

8、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。

9、投资组合报告附注

9.1 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。

9.2 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。

9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,546.35
5	应收申购款	8,419.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,965.60

9.4 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。

9.5 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 2012 年 9 月 30 日。

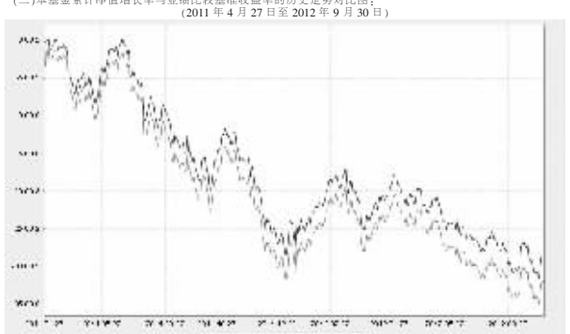
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(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)
2011年4月27日(基金合同生效日)-2011年12月31日	-25.80%	1.14%	-28.79%	1.27%	2.99%	-0.13%
2012年1月1日-2012年6月30日	2.16%	1.23%	2.06%	1.32%	0.10%	-0.09%
2011年4月27日(基金合同生效日)-2012年9月30日	-28.50%	1.16%	-31.90%	1.26%	3.40%	-0.10%

(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:

(2011 年 4 月 27 日至 2012 年 9 月 30 日)



注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同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十一部分(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.基金合同生效后与基金相关的信息披露