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

(2014年第1号)

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2014年3月19日,有关财务数据和净值表现截止日为2013年12月31日。

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:张文伟

成立时间:2003年4月18日

电话:021-38650999

联系人:吴晨莺

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

张文伟先生,董事长,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、海富通基金管理有限公司董事、副总经理。2013年5月起任海富通基金管理有限公司董事长。

邵国有先生,董事,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、海富通基金管理有限公司董事长。2013年5月起转任海富通基金管理有限公司董事。

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。2011年4月至今任海通国际证券集团有限公司董事会主席。

陶乐斯(Ligia Torres)女士,董事,法国与墨西哥双重国籍,双硕士学位,曾任职于东方汇理银行、渣打银行和欧洲联合银行,1996年加入法国巴黎银行集团工作,2010年3月至2013年6月任法国巴黎银行财产管理部英国地区首席执行官,2010年10月至今任法国巴黎银行英国控股有限公司董事,2013年7月至今任法国巴黎投资管理公司亚太区及新兴市场主管。

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。

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、商学院院长及经济系讲座教授,现任香港岭南大学校长。

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,EFAMA(欧洲基金和资产管理协会)和比利时基金公会名誉主席,INVESTPROTECT公司(布鲁塞尔)董事总经理、Pionner投资公司(米兰,都柏林,卢森堡)独立副董事长、Fundconnect独立董事长、Degroof资产管理(布鲁塞尔)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。

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。

谷若鸿(Laurent Couraudon)先生,监事,法国籍,斯特拉斯堡的罗伯特舒曼大学的国际贸易硕士学位。历任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商务拓展主管及法国巴黎银行莫斯科分行首席执行官兼俄罗斯地区总裁等职。2011年至今任法国巴黎银行(中国)有限公司董事会主席兼中国区总裁。

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。

高勇前先生,监事,经济学学士。历任宁波进出口公司财务部会计主管、上海科源医学高科技实业公司财务部财务主管、华安基金管理有限公司财务核算部副总监。2008年4月至今任海富通基金管理有限公司基金运营总监。

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。

陶网雄先生,副总经理,硕士。历任中国电子器材华东公司会计科长、上海中土实业发展公司主管会计、海通证券股份有限公司财务副经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司,2003年4至2006年4月任公司财务部负责人,2006年4月起任财务总监。2013年4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月起兼任海富通中证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。2013年10月起任指数投资部指数投资负责人。

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;戴德舜,投资总监;邵佳民,投资副总监;丁俊,投资副总监;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、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:薛峰

客户服务电话:95525

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: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:蔡一兵

电话:0731-84403360

传真:0731-84403330

联系人:郭磊

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:孙豪志

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:蔡咏

客户服务电话:95578

联系人:李蔡

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:高峰

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:stock.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:魏庆华

客户服务电话:4008-888-993

联系人:黄英

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:龚德雄

客户服务电话:4008918918,021-962518

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:张背北

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: 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: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

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:4008718880

联系人:刘晓明

网址:www.hongtastock.com

18) 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

19) 中信证券股份有限公司

地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

法定代表人:王东明

电话:95558

联系人:顾凌

网址:www.cs.ecitic.com

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:周明

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

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所: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

法定代表人:杨绍信

经办注册会计师:薛竞、叶尔甸

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2014年4月15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2013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	191,254,726.22	96.95
	其中:股票	191,254,726.22	96.95
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	6,004,301.59	3.04
6	其他各项资产	11,679.65	0.01
7	合计	197,270,707.46	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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	20,746,463.62	10.55
C	制造业	11,314,719.61	5.75
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	6,686,856.43	3.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	146,135,719.20	74.28
K	房地产业	6,370,967.36	3.24
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	191,254,726.22	97.22

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	601318	中国平安	459,671	19,182,070.83	9.75
2	600030	中信证券	1,362,589	17,373,009.75	8.83
3	600016	民生银行	2,124,887	16,404,127.64	8.34
4	600036	招商银行	1,463,106	15,933,224.34	8.10
5	601166	兴业银行	1,112,347	11,279,198.58	5.73
6	600000	浦发银行	1,077,262	10,158,580.66	5.16
7	601939	建设银行	1,854,334	7,676,942.76	3.90
8	601328	交通银行	1,941,848	7,456,696.32	3.79
9	601288	农业银行	2,524,147	6,259,884.56	3.18
10	601601	中国太保	313,072	5,801,224.16	2.95

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报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1 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。

8.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同,本基金不参与股指期货交易。

9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

9.1 本基金投资国债期货的投资政策

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

9.2 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。

9.3 本基金投资国债期货的投资评价

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

10、投资组合报告附注

10.1 报告期内本基金投资的中国平安(601318)于2013年10月15日发布《中国平安保险(集团)股份有限公司关于平安证券收到中国证监会行政处罚决定书的公告》,中国证券监督管理委员会决定责令平安证券改正及给予警告,没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐业务许可3个月。

对该股票的投资决策程序的说明:本ETF基金系指数型基金,对该股票的投资均系被动按照指数成分股进行复制。

报告期内本基金投资的农业银行(601288)于2013年10月22日披露称,中国农业银行股份有限公司作为债务融资工具主承销商,近期涉及未按规定开展后续管理工作、未合规履行持有人会议有关职责以及未按业务规范要求开展尽职调查等多项违反自律规则指引的情形。根据相关自律规定,经交易商协会秘书处专题办公会审议决定,给予农业银行通报批评处分,并处责令改正。

对该股票的投资决策程序的说明:本基金系指数型基金,对该股票的投资均系被动按照指数成分股进行复制。

其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

10.2 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。

10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,957.25
2	应收证券清算款	4,517.89
3	应收股利	-
4	应收利息	1,204.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	0.01
9	合计	11,679.65

10.4 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。

10.5 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2013年12月31日。

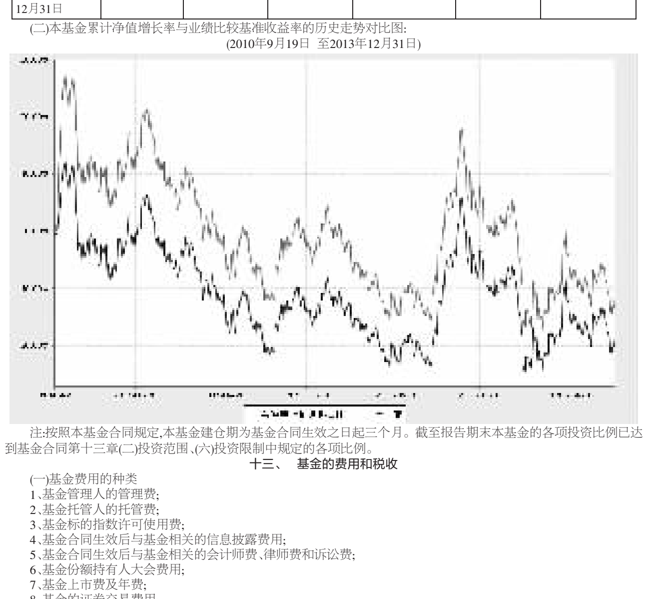
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(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%
2012年1月1日至2012年12月31日	17.85%	1.22%	16.92%	1.26%	0.93%	-0.04%
2013年1月1日至2013年12月31日	-13.39%	1.65%	-15.14%	1.68%	1.75%	-0.03%
自基金合同生效起至2013年12月31日	-18.77%	1.41%	-11.65%	1.48%	-7.12%	-0.07%

(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2013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、第三节 基金管理人"部分:

1.更新了基金管理人联系人信息;

2.更新了郑国汉先生、王明权先生的简历;

3.更新了投资决策委员会名单。

二、第四节 基金托管人"部分:对基金托管人的主要人员情况和基金托管业务经营情况进行了更新。

三、第五节 相关服务机构"部分:

1.对部分申购赎回代理券商的相关信息进行了更新;

2.更新了会计师事务所的相关信息。

四、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。

五、第十一节 基金的投资"和 第十二节 基金的业绩"部分,根据2013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2013年12月31日。

六、第二十二节 基金托管协议的内容摘要"部分,更新了基金管理人的联系人信息。

海富通基金管理有限公司

2014年4月30日

证券代码:002232 证券简称:启明信息 公告编号:2014-021

启明信息技术股份有限公司 第四届董事会2014年第四次临时会议决议的公告

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,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

启明信息技术股份有限公司(以下称"公司")于2014年4月29日9:00以通讯形式召开了第四届董事会2014年第四次临时会议。本次会议的会议通知已于2014年4月28日以书面、电话、传真、电子邮件等方式通知各位董事,本次会议应出席并参与表决董事9人,实际出席并表决董事9人,9名董事以通讯形式参与表决,会议的参加人数、召集、召开程序、议事内容均符合有关法律、法规和《公司章程》的规定。

董事会成员以通讯表决的方式,做出了如下决议:

1、会议以9票赞成,0票反对,0票弃权的表决结果审议通过了《关于规范公司控股股东及实际控制人行为的专项方案的议案》。

根据中国证监会吉林监管局下发的《关于开展"防范上市公司控股股东及实际控制人行为"专项工作的通知》(吉证监发【2014】第43号)的要求,公司制定了相关方案。详细内容见于2014年4月30日刊登在《证券时报》、《中国证券报》及巨潮资讯网上的《关于防范控股股东及实际控制人侵占公司利益的机制的建立和完善情况公告》(公告编号:2014-022)及《关于规范公司控股股东及实际控制人行为的专项方案》。

特此公告。

启明信息技术股份有限公司

董事会

二〇一四年四月三十日

证券代码:002232 证券简称:启明信息 公告编号:2014-022

启明信息技术股份有限公司 关于防范控股股东及实际控制人 侵占公司利益的机制的建立和完善 情况公告

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,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

根据中国证监会吉林监管局下发的《关于开展"防范上市公司控股股东及实际控制人行为"专项工作的通知》(吉证监发【2014】43号)文件要求,启明信息技术股份有限公司(以下简称"公司")现将防范控股股东及实际控制人侵占公司利益机制建立和完善情况自查并公告如下:

一、防范控股股东及实际控制人侵占公司利益的机制建设情况

公司按照《公司法》、《证券法》、《上市公司治理准则》、《上市公司章程指引》、《上市公司股东大会治理规则》等法律法规的监管要求,制定了《公司章程》、《股东大会议事规则》、《董事会议事规则》、《监事会议事规则》、《独立董事议事规则》、《关联交易内部控制规范》、《信息披露制度》、《内部审计制度》等内部控制制度,对规范公司与控股股东、实际控制人及其关联方资金往来起了重要作用。

1、《公司章程》对控股股东和实际控制人行为作出严格要求,禁止控股股东及实际控制人损害上市公司和公众利益。

《公司章程》第三十九条规定:公司的控股股东、实际控制人员不得利用其关联关系损害公司利益。违反规定的,给公司造成损失的,应当承担赔偿责任。

公司控股股东及实际控制人对公司和公司社会公众股股东负有诚信义务。控股股东应严格依法行使出资人的权利,控股股东不得利用利润分配、资产重组、对外投资、资金占用、借款担保等方式损害公司和社会公众股股东的合法权益,不得利用其控制地位损害公司和社会公众股股东的利益。

以该基本准则为出发点,公司在内控制度中严格规定了与控股股东关联性资金往来的决策流程以及相应披露程序,同时严格控制与控股股东之间进行非经营性资金往来。

2、公司在《公司章程》、《股东大会议事规则》、《董事会议事规则》、《总经理工作细则》等制度中对于保障上市公司独立性进行了明确规定(包括上市公司资产完整、人员独立、财务独立、机构独立和业务独立等方面),并确定了股东大会、董事会、董事长、总经理等各自的权限(包括对外投资、收购出售资产、资产抵押、对外担保事项、委托理财、关联交易、资金运用和合同管理等权限);同时对于董事、监事、高级管理人员等权利、责任及追究均进行了明确规定。另外,在《关联交易内部控制规范》中,对关联人及关联交易的界定、关联交易的基本原则、关联交易的表决回避制度、关联交易审批权限和审批程序、关联交易的信息披露进行了详尽的规定,使公司防止资金占用长效机制得到进一步的健全。

3.对公司实际控制人、大股东及其关联方的行为进行了规范,公司实际控制人、大股东及其关联方已分别签署了《控股股东、实际控制人声明及承诺书》,承诺:"依法行使股东权利,不滥用控制权损害公司或者其他股东的利益;不以任何方式占用上市公司资金及要求上市公司提供违法违规担保;不以任何方式影响公司的独立性,保证上市公司资产完整、人员独立、财务独立、机构独立和业务独立。"

4、《公司章程》对担保对象资格和担保方式进行了严格规定,规定公司不得以任何形式为任何法人、非法人单位或自然人提供担保,但因公司发生合并、分立、或减资事项时,债权人依法要求提供担保的,应当取得出席董事会议的三分之二以上董事同意并经全体独立董事三分之二以上同意,且经股东大会审议通过。未经董事会或股东大会批准,上市公司不得对外提供担保。

5、除了在流程以及决策上控制外,公司还通过独立董事、监事会以及内部审计等监督程序保证公司与控股股东资金往来的规范性。公司《独立董事议事规则》第十八条规定公司关联交易必须取得独立董事的事前认可,第二十二条规定,独立董事应对"公司的股东、实际控制人及其关联企业对公司现有或新发生的总额高于300万元或高于公司最近经审计净资产值的5%的借款或其他资金往来,以及公司是否采取有效措施回收欠款"发表独立意见。自公司上市以来,每年半年度报告以及年度报告,公司独立董事都就公司与大股东关联资金往来发表独立意见。

综上,公司已经建立了较为完善的内部控制制度,现有制度对于公司与大股东、实际控制人及其关联方的资金往来从内容、调查、决策、信息披露等方面进行了规定,同时独立董事、内部审计部门及聘请的外部审计机构对相关资金往来进行监督和控制,能有效的防止大股东及其关联方资金占用上市公司资金等问题。截止目前,公司未发生过控股股东及实际控制人以及关联方非经营性占用本公司资金的情况。

二、防范控股股东及实际控制人侵占公司利益机制的完善情况

1、制定《关于规范公司控股股东及实际控制人行为的专项方案》,进一步加强和规范公司的资金管理,防止和杜绝控股股东及关联方占用公司资金行为的发生,保护公司、股东和其他利益相关人的合法权益。

2、严格执行内部控制制度,形成有效的监督机制,防范资金违规占用。公司将严格执行已有的规章制度,并根据公司实际和监管部门的要求不断修改和完善公司内部控制制度。公司董事会审计委员会和监事会未来将进一步加强对关联交易的检查工作,促进公司内控制度健全和完善及内控工作的有效执行。

3、加强培训工作,不断提高相关人员的法规意识和规范运作意识。公司将对董、监事高管人员定期进行相关法律、法规的培训,监事会、内审部门有效监督,使董事、监事知法、懂法、守法,认真履行职责,严格按照法律办事,自觉维护上市公司的利益。

启明信息技术股份有限公司

二〇一四年四月二十九日

证券代码:002145 公司简称:中核钛白 公告编号:2014-022

中核华原钛白股份有限公司 第四届董事会第二十二次会议决议公告

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,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中核华原钛白股份有限公司(下称公司)董事会于2014年4月26日以电子邮件方式发出关于召开第四届董事会第二十二次(临时)会议的通知及相关资料。会议在保证所有董事充分发表意见的前提下,于2014年4月29日以专人送达或传真方式进行了审议表决,会议应参与表决董事9名,实际参与表决董事9名。会议的召开符合《公司法》和《公司章程》规定,决议合法有效。本次会议经公司董事表决,形成了如下决议:

一、会议以9票同意,0票反对,0票弃权审议通过了《前次募集资金使用情况报告》;

报告内容详见公司4月30日登载在巨潮资讯网(@http://www.cninfo.com.cn/default.htm)公告。

信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)出具了鉴证报告,详见公司 4 月 30日登载在巨潮资讯网(@http://www.cninfo.com.cn/default.htm)公告。

本议案需提交公司股东大会审议。

二、会议以9票同意,0票反对,0票弃权审议通过了《关于召开2014年第一次临时股东大会的议案》。

同意公司于2014年5月17日以现场表决的方式召开公司2014年第一次临时股东大会。详见2014年4月30日刊登在《中国证券报》、《证券时报》及巨潮资讯网(@http://www.cninfo.com.cn/default.htm)的召开股东大会的通知公告。

备查文件:

1、中核华原钛白股份有限公司第四届董事会第二十二次会议决议。

中核华原钛白股份有限公司董事会

2014年4月30日

证券代码:002145 公司简称:中核钛白 公告编号:2014-023

中核华原钛白股份有限公司关于 召开2014年第一次临时股东大会的 通知公告

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,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中核华原钛白股份有限公司第四届董事会第二十二次会议决定召开公司2014年第一次临时股东大会,本次股东大会以现场表决的方式召开。现将会议的有关事项公告如下:

一、召开会议的基本情况:

1、会议召集人:公司董事会

2、现场会议时间:2014年5月17日(星期六)上午10:00

3、现场会议地点:甘肃省嘉峪关市和诚西路359号公司会议室

4、股权登记日:2014年5月9日(星期五)。

5、会议召开方式:本次股东大会采取现场投票表决的方式。

6、会议出席对象

(1)截至2014年5月9日下午交易结束后在中国证券登记结算公司深圳分公司登记在册的本公司全体股东。

(2)公司董事、监事、高级管理人员。

(3)公司聘请的见证律师。

7、因故不能出席会议的股东可委托代理人出席。

二、会议审议事项

本次股东大会审议单一议案:《前次募集资金使用情况报告》。

三、出席现场会议登记办法

1、登记方法:个人股东亲自出席会议的应出示本人身份证、证券帐户卡;受托代理他人出席会议的,应出示委托人身份证复印件、本人身份证、授权委托书、委托人证券帐户卡;法人股股东由法定代表人出席会议的,应出示法人单位营业执照复印件、本人身份证、证券账户卡;委托代理人出席会议的,代理人应出示本人身份证、法人单位营业执照复印件、证券账户卡、授权委托书进行登记。异地股东可用传真或信函方式登记,不接受电话登记。

2、登记时间:2014年5月16日上午9:00-11:30下午14:00-17:30。

3、登记地点:甘肃省嘉峪关市和诚西路359号二楼(董事会办公室)。

4、通讯地址:甘肃省嘉峪关市和诚西路359号 邮编:735100

联系人:夏云春 电 话:0937-6211779 传真:0937-6211771

电子信箱:xiayunchun@126.com

四、其他事项

本次现场会议会期半天,与会股东所有费用自理。

特此公告。

中核华原钛白股份有限公司董事会

2014年4月30日

附件一:

中核华原钛白股份有限公司2014年第一次临时股东大会回执

致:中核华原钛白股份有限公司("贵公司")

本人拟亲自/ 委托代理人 ,出席贵公司于2014年5月17日(星期五)上午10:00时整在甘肃省嘉峪关市举行的贵公司2014年第一次临时股东大会。

姓 名	
身份证号	
通讯地址	
联系电话	
股东帐号	
持股数量	

日期:2014年5月 日 签署:

附注:

1、请用正楷书写中文全名。

2、请附上身份证复印件和股票帐户复印件。

3、委托代理人出席的,请附上填写好的《股东授权委托书》(见附二)。

附件二:

授 权 委 托 书

兹全权委托 先生(女士)代表本人(公司)出席中核华原钛白股份有限公司本次股东大会,并行使表决权。

委托人签名: 受托人签名:

委托人股东账号: 受托人身份证号:

委托人身份证号: 委托股数:

委托日期:2014年5月 日

一、表决指示:

1、《前次募集资金使用情况报告》。

赞成 □ 反对 □ 弃权 □

二、如果本委托人不作具体指示,受托人是否可以按自己的意思表决:

是( ) 否( )

三、本委托书有效期限:

委托人签名(委托人为单位的加盖单位公章):

委托日期:2014年5月 日

*说明:授权委托书复印或按以上格式自制均有效,委托人应在本委托书签名(委托人为单位的加盖单位公章)。

证券代码:002145 公司简称:中核钛白 公告编号:2014-024

中核华原钛白股份有限公司关于收到 重大资产重组承诺利润补偿款的公告

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,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

2014年4月24日,中核华原钛白股份有限公司(下称中核钛白或公司)在安徽马鞍山召开了第四届董事会第二十一次会议,审议通过了《2013年度重大资产重组盈利预测实现情况的说明》(详细见2014年4月26日公告),信永中和会计师事务所(特殊普通合伙)对本说明出具了审核报告(XYZH/2013XAA1026-4),根据最终审计数据,安徽金星钛白(集团)有限公司(下称金星钛白)2013年度完成扣除非经常性损益后归属于母公司的净利润为6272.82万元。

根据2012年9月27日签订的《中核华原钛白股份有限公司与李建锋、郑志锋、陈富强、胡建龙、张家港以诺股权投资企业(有限合伙)之盈利预测补偿协议》之约定,上述五位股东承诺金星钛白2013年度实现扣除非经常性损益后归属于母公司的净利润如低于8846.49万元,则差额部分以现金方式全额一次性补偿给中核钛白,且股东之间承担无限连带责任。

2014年4月26日,公司已正式函告上述五为股东,请各位股东根据原持股比例履行协议约定,并将补偿款共计2573.67万元于30日内汇至中核钛白专户。截至2014年4月28日下午,中核钛白银行专户已经收到全部股东补偿款2573.67万元。

按照《企业会计准则》的相关规定,上述补偿款直接计入公司资本公积,不影响中核钛白2014年度损益。

至此,金星钛白原股东对于重大资产重组关于金星钛白2013年度业绩承诺的补偿已履行完毕。

特此公告。

备查文件:2,573.67万元进账单。

中核华原钛白股份有限公司董事会

2013年12月30日