海富通中证100指数证券投资基金(LOF)更新招募说明书摘要

(2014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:中国银行股份有限公司

重要提示

海富通中证100指数证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金")经2009年8月31日中国证券监督管理委员会证监许可【2009】879号文核准募集。本基金的基金合同于2009年10月30日正式生效。本基金类型为上市契约型开放式。

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。

投资有风险,投资人申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书所载内容截止日为2014年4月30日,有关财务数据和净值表现截止日为2014年3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: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。

李确前先生,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2014年6月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月任海富通精选或可混合基金经理,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牟永宁先生,任职时间为2009年10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)基本情况

名称:中国银行股份有限公司(简称"中国银行")

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期:1983年10月31日

注册资本:人民币贰仟柒拾玖给叁亿陆仟肆佰伍拾伍万贰仟肆佰叁拾柒元整

法定代表人:田国立

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号

托管业务部总经理:李爱华

托管部门信息披露联系人:王永民

客服电话:95566

传真:(010)66594942

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:张文伟

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.场外销售机构

(1)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:田国立

电话:010-66596688

传真:010-66593777

客户服务电话:95566

网址:www.boc.cn

(2)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

法定代表人:姜建清

客户服务中心电话:95588

电话:010-66107900

传真:010-66107914

网址:www.icbc.com.cn

(3)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

(4)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

(5)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:牛锡明

客户服务电话:95559

网址:www.bankcomm.com

(6)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

(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:高天,虞谷云

网址:www.spdb.com.cn

(8)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

网址:www.bank.pingan.com

(9)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:常振明

客户服务电话:95558

网址:http://bank.ecitic.com/

(10)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

网址:www.cmbc.com.cn

(11)广发银行股份有限公司

地址:广州市越秀区东风东路713号

法定代表人:董建岳

客户服务电话:4008308003

网址:http://www.cgbchina.com.cn/

(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)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

(14)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

(15)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

(16)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

(17)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

(18)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

(19)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

(20)兴业证券股份有限公司

地址:福建省福州市湖东路268号

法定代表人:兰荣

客户服务电话:95562

联系人:谢高得

网址:www.xyzq.com.cn

(21)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

(22)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:吴晓东

客户服务电话:95513

联系人:盛宗凌

网址:www.lhzq.com

(23)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

(24)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

(25)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、4008895523

联系人:高天

网址:www.sywg.com

(26)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

(27)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

(28)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:宋明

网址:www.chinastock.com.cn

(29)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

(30)世纪证券有限责任公司

地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

法定代表人:卢长才

电话:0755-83199599

联系人:张婷

网址:www.csco.com.cn

(31)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:95548

联系人:俞会亮

网址:www.bigsun.com.cn

(32)中信万通证券有限责任公司

地址:山东省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:95548

联系人:吴忠超

网址:www.zxwt.com.cn

(33)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:潘锴

网址:www.nesc.cn

(34)瑞银证券有限责任公司

地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人:程宜荪

客户服务电话:400-887-8827

联系人:牟冲

网址:www.ubsecurities.com

(35)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:李慕

网址:www.gyzq.com.cn

(36)德邦证券有限责任公司

地址: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

(37)宏源证券股份有限公司

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

(38)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

(39)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、26层

法定代表人:刘学民

客户服务电话:4008881888

联系人:毛诗莉

网址:http://www.fcsc.com

(40)湘财证券股份有限公司

地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

法定代表人:林俊波

客户服务电话:400-888-1551

联系人:胡莹

网址:www.xcsc.com

(41)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层

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

(42)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400-600-8008

联系人:刘毅

网址:http://www.china-invs.cn/

(43)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:金立群

公司总机:010-65051166(北京);021-58796226(上海)

联系人:罗文雯

网址:www.cicc.com.cn

(44)中国民族证券有限责任公司

地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40F-43F

法定代表人:赵大建

客户服务电话:400-889-5618

联系人:李薇

网址:www.e5618.com

(45)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

(46)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:张志刚

客户服务电话:400-800-8899

联系人:唐静

网址:www.cindasc.com

(47)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:尚峰

网址:www.cgws.com

(48)方正证券股份有限公司

地址:湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层

法定代表人:雷杰

客户服务电话:95571

联系人:郭军瑞

网址:www.foundersc.com

(49)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.gzhfzq.com.cn

(50)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

(51)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:张运勇

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

(52)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

(53)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

(54)大通证券股份有限公司

地址:大连市沙河口区会展路129号

法定代表人:董永成

客户服务电话:4008169169

联系人:谢立军

网址:www.daton.com.cn

(55)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

网址:www.jhzq.com.cn

(56)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

(57)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

(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:魏庆华

客户服务电话:4008-888-993

联系人:黄英

网址:www.dxzq.net

(59)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

联系人:郭磊

网址:www.cfzq.com

(60)民生证券股份有限公司

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:www.mszq.com

(61)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:邓鹏怡

网址:http://www.hlzqgs.com

(62)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

(63)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:孔佑杰

客户服务电话:010-88086830

联系人:陈文彬

网址:www.rxzq.com.cn

(64)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:吴骏

客户服务电话:4008698698

联系人:李欣

网址:www.ydsc.com.cn

(65)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

(66)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:尹伶

网址:www.txsec.com

(67)华西证券有限责任公司

地址:四川省成都市青羊区陕西街239号

法定代表人:杨炯洋

客户服务电话:400-888-8818 95584

联系人:李慧灵

网址:www.hx168.com.cn

(68)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1、J单元

法定代表人:薛峰

客户服务电话:4006-788-887

联系人:童彩平

网址:www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

(69)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:张裕

网址:www.fund123.cn

(70)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:阚迪

网址:www.ehowbuy.com

(71)上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人:张跃伟

联系人:王艳萍

客服电话:400-089-1289

公司网站: www.erichfund.com

(72)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路7 6 5 0号2 0 5室

法定代表人:汪静波

客户服务电话:400—821—5399

联系人:魏可萍

网址: www.noah-fund.com

(73)上海天天基金销售有限公司

地址:徐汇区龙田路190号2楼2层

法定代表人:其实

客户服务电话:400-1818-188

联系人:纳小丹

网址: www.1234567.com.cn

(74)和讯信息科技有限公司

地址:上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦25楼C区

法定代表人: 王莉

客户服务电话:400-920-0022

联系人:于杨

网址: licaike.hexun.com

(75)北京展恒基金销售有限公司

地址:北京顺义区后沙峪镇安富街6号

法定代表人: 闫振杰

客户服务电话:400-888-6661

联系人:宋丽冉

网址: www.myfund.com

(76)浙江同花顺基金销售有限公司

地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼

法定代表人:凌顺平

客户服务电话:0571-88920897、4008-773-772

联系人:胡璇

网址:www.5ifund.com

(77)万银财富(北京)基金销售有限公司

地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内

法定代表人:李招弟

客户服务电话: 400-808-0069

联系人:高晓芳

网址:www.wy-fund.com

3、场内销售机构

本基金的场内认购通过深圳证券交易所内具有基金销售业务资格的会员单位(具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告)进行。尚未取得相应业务资格,但属于深圳证券交易所会员的其他机构,可代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。

(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: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:吕红

联系电话:021-31358666-8776

经办律师:秦悦民、王利民

(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:海富通中证100指数证券投资基金(LOF)

五、基金类型

基金类型:上市契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金的投资目标为:本基金采用指数化投资方式,通过有效的投资程序约束和数量化风险管理手段,控制基金投资组合相对于业绩比较基准的偏离度,实现对业绩比较基准的有效跟踪。本基金管理人将力争控制本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0.35%,年化跟踪误差小于4%。

七、投资方向和范围

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及备选成份股、新股(首次公开发行股票或增发)、固定收益产品、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中股票资产占基金资产的比例为90%-95%,投资于相关标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产的80%。现金、固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-10%,其中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%。

如今后法律法规或监管机构允许基金投资其他金融工具,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

本基金采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,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,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,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调整,以便实现对跟踪误差的有效控制。

1. 资产配置比例

本基金股票资产占基金资产的比例为90%-95%,本基金将根据市场的实际情况,适当调整基金资产的配置比例,以保证对标的指数的有效跟踪。如果法律法规允许,本基金在履行适当程序后可以将股票投资比例提高到基金资产净值的100%,业绩比较基准同时相应变更,此事项无需召开基金份额持有人大会。

2. 股票投资组合构建

(1)股票组合构建原则及方法

本基金股票资产投资采用完全复制标的指数的方法进行投资。通常情况下,本基金根据标的指数成分股票在指数中的权重确定成分股票的买卖数量,但在特殊情况下,本基金将选择其它股票或股票组合对标的指数中的股票加以替换,这些情况包括但不限于以下情形:

1)法律法规的限制;

2)标的指数成份股流动性严重不足,或因受股票停牌的限制等其他市场因素,使基金管理人无法依指数权重购买某成份股;

3)本基金资产规模过大导致本基金持有该股票比例过高;

4)成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼;

5)预期标的指数的成份股即将调整。

为了减小跟踪误差,本基金按照同行业,相近市值,相关性高及β值相近等原则来选择替代股票。

(2)股票组合调整

1)定期调整

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)不定期调整

a)标的指数成份股日常跟踪

当成份股发生增发、配股、分红等情况或其他原因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及时调整股票投资组合。

b)标的指数成份股票临时调整

在标的指数成份股票调整周期内,若出现成份股票临时调整的情形,本基金将密切关注样本股票的调整,并及时制定相应的投资组合调整策略。

c)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,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数。

3)跟踪偏离的监控与管理

本基金管理人将每日跟踪基金组合与标的指数表现的偏离度,每月末、季度末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. 债券资产的配置策略

本基金债券投资为在跟踪误差与流动性风险双重约束下的投资。本基金将以降低基金的跟踪误差为目的,在考虑流动性风险的前提下,构建债券投资组合。

4. 投资决策

1)决策依据

(1)投资决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定;

(2)投资决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比;

(3)投资部策略分析师、股票分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告,为投资策略提供依据。

2)决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会不定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中既密切合作,又责任明确,在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的决策流程如下:

(1)投资决策委员会依据国家有关基金投资方面的法律和行业管理法规,决定公司针对市场环境重大变化所采取的对策;决定投资决策程序和风险控制系统及做出必要的调整;对旗下基金重大投资的批准与授权等。

(2)投资总监在公司有关规章制度授权范围内,对重大投资进行审查批准;并且根据基金合同的有关规定,在组合业绩比较基准的基础上,制定各组合资产和行业配置的偏差度指标。

(3)分析师根据宏观经济、货币财政政策、行业发展动向和上市公司基本面等进行分析,提出宏观策略意见、债券配置策略及行业配置意见。

(4)定期不定期召开基金经理例会,基金经理们在充分听取各分析师意见的基础上,确立公司对市场、资产和行业的投资观点,该投资观点是指导各基金进行资产和行业配置的依据。

(5)基金经理在投资总监授权下,根据基金经理例会所确定的资产/行业配置策略以及偏差度指标,在充分听取策略分析师宏观配置意见、股票分析师行业配置意见及固定收益分析师的债券配置意见,进行投资组合的资产及行业配置;之后,在股票分析师设定的股票池内,根据所管理组合的风险收益特征和流动性特征,构建基金组合。

(6)基金经理下达交易指令到交易室进行交易。

(7)定量分析师负责对投资组合进行事前、事中、事后的风险评估与控制。

(8)定量分析师负责完成内部基金业绩评估,并完成有关评价报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要,对上述投资管理程序做出调整。

九、业绩比较基准

基金业绩比较基准=中证100指数×95%+活期存款利率(税后)×5%

中证100指数是从沪深300指数样本股中挑选规模最大的100只股票组成样本股,以综合反映沪深证券市场中最具市场影响力的一批大市值公司的整体状况。在指数样本股选取方面,中证100指数以沪深 300 指数样本股作为样本空间。根据总市值对样本空间内股票进行排名,挑选排名前 100 名的股票组成样本,但经专家委员会认定不宜作为样本的股票除外。

如果中证100指数被停止编制及发布,或由其他指数替代,或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数的情形下,或者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的合法权益的原则,在履行适当程序以后变更基金的投资目标、投资范围、标的指数和业绩比较基准。

十、风险收益特征

本基金是股票型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。

十一、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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年5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2014年3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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	415,390,820.73	92.21
	其中:股票	415,390,820.73	92.21
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	34,981,790.13	7.77
7	其他资产	108,535.03	0.02
8	合计	450,481,145.89	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

2.2 指数投资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	27,292,498.24	6.07
C	制造业	119,192,652.30	26.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,623,254.34	2.59
E	建筑业	14,305,961.79	3.18
F	批发和零售业	4,277,278.98	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	10,232,712.45	2.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,296,890.46	1.40
J	金融业	200,108,154.60	44.51
K	房地产业	16,679,031.96	3.71
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	2,197,397.99	0.49
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	3,184,987.62	0.71
	合计	415,390,820.73	92.40

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 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

代码	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	601318	中国平安	659,285	24,762,744.60	5.51
2	600016	民生银行	3,084,185	23,624,857.10	5.26
3	600036	招商银行	2,348,150	23,058,833.00	5.13
4	600030	中信证券	1,913,460	20,148,733.80	4.48
5	601166	兴业银行	1,690,533	16,093,874.16	3.58
6	600000	浦发银行	1,529,425	14,866,011.00	3.31
7	000002	万 科A