

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

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】965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。

本基金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，并接受《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规范性文件约束。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，所得可能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，充分认识到自身的风险承受能力、理性判断市场，对投资本基金的风险、时机、数量等投资行为作出独立决策，投资者根据所持份额享受基金收益，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、标的指数波动带来的风险以及本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后的变现风险等等。本基金属股票型基金，风险收益高于混合基金、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，具有和标的指数类似的风险收益特征。本基金属证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。

基金的投资业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金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本基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2014年9月19日，有关财务数据和净值表现截止日为2014年6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

住所：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：张文生

成立时间：2003年4月18日

电话：021-38650999

联系人：吴晨晖

注册资本：1.5亿元人民币

股权结构：海富通证券股份有限公司51%、法国巴黎投资管理有限公司49%。

（二）主要人员情况

张文生先生，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，海通证券股份有限公司总部副总经理、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。

胡晓阳先生，董事，副教授。历任桂林电子科技大学党委书记、长春师范学院党委书记、长春新世纪广场有限公司董事长兼总裁、海富通基金管理有限公司总经理培训中心总经理、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。

吉宁先生，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、交通银行北京分行营业部总经理、海通证券北京财富管理总部总经理。1997年至今任海通证券股份有限公司副总裁，2011年4月至今任海富通基金管理有限公司董事长。

魏斯东（Luis Torres）先生，董事，法国与墨西哥双重国籍，双硕士学历，曾任纽约及汇理银行、渣打银行及欧洲联合银行，1996年加入法国巴黎银行集团工作，2010年3月至2013年6月任法国巴黎银行资产管理部欧洲地区首席执行长，2010年10月至今任法国巴黎银行美国控股公司董事，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。

刘国祥先生，董事，总经理，工商管理硕士。历任法国金融集团Euroequipment S.A.公司总裁助理，富通银行区域经理、大中华地区主管，富通基金亚洲有限公司投资经理、业务发展部总经理、首席执行长。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事、总经理。

胡斌先生，独立董事，经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达大学大学经济系教授、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教授，现任香港科技大学教授。

巴内特（Marc Bayot）先生，独立董事，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、Pioneer投资公司（米兰、都柏林、卢森堡）独立副董事长、Fundconnect独立董事、Degiro资产管理（布鲁塞尔）独立董事和法国巴黎银行FB Flexible SICAV 独立董事。

李祖前先生，独立董事，硕士，高级经济师。历任上海海科通“广”党委副书记、书记，上海市公用事业管理局副局长，上海市出租汽车公司党委书记，现任大众交通（集团）股份有限公司董事兼兼总经理。上海大众公用事业（集团）股份有限公司董事长、上海大众昂立股份有限公司董事长。

李融前先生，监事长，经济学硕士，高级经济师。历任安徽省财政厅中企金融处主任科员，安徽省国有资产管理局科长，海通证券计划财务部副经理、总经理和财务总监。

胡建伟（Bruno Wei）先生，监事，法国国籍，硕士。历任法国巴黎银行东南亚负责人、亚洲融资项目副经理，法国巴黎银行跨境企业全球业务客户经理，亚洲金融机跨境行业部门负责人、零售银行代表，现任南京银行副行长。

梁万策先生，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内部审计，2003年4月加入海富通基金管理有限公司，历任稽核总监、监察稽核总监，现任合规助理兼上海富通资产管理股份有限公司合规负责人。

高蔚先生，董事，经济学硕士。历任宁波进出口公司财务部主任主管、上海科顺医药高科技技术有限公司财务部主任，华安基金管理有限公司财务核算部副总监。2008年4月起任海富通基金管理有限公司基金运营总监，现任任经理助理兼上海富通资产管理股份有限公司中后台运营总监。

郭明才先生，督察长，硕士。历任加拿大BBCC Tech & Trade Int'l Inc.公司高级财务管理、加拿大Future Electronics 公司财务主管、国际金融业务经理和高级研究员，海通证券股份有限公司对外合作部主管。2003年 年至今任海富通基金管理有限公司督察长。

陶川先生，副总经理，硕士。历任中国人民银行上海分行助理经济师，富通银行欧洲助理实任、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。2014年9月起兼任上海富通资产管理股份有限公司执行董事、总经理。

陶海健先生，副总经理，硕士。历任中国电子器材华东分公司会计科长、上海中实业发展公司主管会计、海通证券股份有限公司财务部经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司，2003年4月至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监。

陈嘉祥先生，副总经理，硕士。历任上海远东证券经纪处、国投证券有限公司、上海管理总部副经理、上海清算中心、民生证券研究所长期助理、任诚副经理、基金证券经纪有限公司副经理等职。2011年7月加入海富通基金管理有限公司，任总经理助理。2014年10月，任海富通基金管理有限公司副总监。

刘翠华女士，硕士，先后担任过交通银行、华安基金管理有限公司、曾任任安上证180ETF基金经理助理；2007年1月至2010年6月担任任安上证180ETF基金经理。2008年4月至2010年6月担任任平安中国A股增强指数基金经理。2010年6月起任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月起兼任任海富通上证周期ETF及海富通上证周期ETF联接基金经理。2012年1月起兼任任海富通中证100指数(LOF)基金经理。2012年5月起兼任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。

本基金历任基金基金经理为张文生，任职时间为2010年9月至2012年1月。

投资决策委员会设委员有：田仁灿、总经理：戴国强，投资总监：邵健先生，总经理助理丁俊，投资副总监：孙晓峰，董事及风险管理部负责人，兼任上海富通资产管理股份有限公司投资总监。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，则该基金的投资由该会议。

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340,018,545,827元

联系电话：010-61010799

联系人：赵会军

三、相关服务机构

（一）基金销售机构情况

1)申银万国证券有限公司（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：李奕明

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：李峻熙

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

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：蔡兵

电话：0731-84403360

传真：0731-84403330

联系人：郝艳

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：95338

联系人：李宏达

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：陈树华

客户服务电话：95578

联系人：李黎

网址：www.gyqz.com.cn

7)长城证券股份有限公司

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：4006668888

联系人：高峰

网址：www.cgws.com

证券代码：000151 证券简称：中成股份 公告编号：2014-49

中成进出口股份有限公司2014年第二次临时股东大会决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

特别提示：

1、本次股东大会没有出现否决议案。

2、本次股东大会不涉及变更前次股东大会决议的情况。

一、会议召开和出席情况：

（一）会议召开情况

1、召开时间：

现场会议召开日期和时间：2014年10月31日下午14:30；

网络投票时间：2014年10月30日至10月31日。

其中，通过深圳证券交易交易系统进行网络投票的具体时间为：2014年10月31日上午9:30—11:30、下午13:00—15:00；通过深圳证券交易所互联网投票系统投票的具体时间为：2014年10月30日下午15:00—10月31日下午15:00。

2、现场会议召开地点：北京市东城区安民门西滨河路9号中成集团大厦9层会议室

3、召开方式：现场会议与网络投票相结合的方式

4、召集人：公司董事会

5、主持人：董事长刘学义先生

6、会议的召开符合《公司法》、《深圳证券交易所股票上市规则》、《公司章程》等有关规定，会议合法有效。

（二）会议的出席情况

截至本次股东大会股权登记日2014年10月24日，公司股份总数为295,980,000股。

出席本次股东大会的股东及股东授权代表12人，代表股份146,173,724股，占公司有表决权股份总数的49.3863%。

其中，参加现场投票的股东及授权代表1人，代表股份145,552,133股，占公司有表决权股份总数的49.1763%；参加网络投票的股东11人，代表股份621,591股，占公司有表决权股份总数的0.2100 %。

公司董事、监事、高级管理人员及律师列席了本次股东大会。

二、议案审议表决情况

本次股东大会以现场表决和网络投票相结合的方式，审议通过了以下议案：

（一）关于修改《中成进出口股份有限公司章程》的议案

同意146,029.073%；出席会议股东所持股份的99.910 %；反对102,800股，占出席会议股东所持股份的0.0703%；弃权41,900股，占出席会议股东所持股份的0.0287 %。

其中，持股份百分之五以下股东的表决情况：同意476,891股，占出席会议持股份百分之五以下股东所持有效表决股份的76.7210%；反对102,800 股，占出席会议持股份百分之五以下股东所持有效表决股份的16.5382 %；弃权41,900股，占出席会议持股份百分之五以下股东所持有效表决

股份的7.408 %。

表决结果：上述议案获得出席本次股东大会有效表决权股份总数的2/3以上通过，本次股东大会审议通过了上述议案。

（二）关于修改《中成进出口股份有限公司股东大会议事规则》的议案

同意146,012,724股，占出席会议股东所持股份的99.8899 %；反对102,800股，占出席会议股东所持股份的0.0703%；弃权E8,200股，占出席会议股东所持股份的0.0398 %。

其中，持股份百分之五以下股东的表决情况：：同意404,591股，占出席会议持股份百分之五以下股东所持有效表决股份的74.0987 %；反对102,800股，占出席会议持股份百分之五以下股东所持有效表决股份的16.5382 %；弃权E8,200股，占出席会议持股份百分之五以下股东所持有效表决股份的0.3631 %。

表决结果：本次股东大会审议通过了上述议案。

（三）关于修改《中成进出口股份有限公司董事会工作条例》的议案

同意146,054,624股，占出席会议股东所持股份的99.9185 %；反对102,800股，占出席会议股东所持股份的0.0703%；弃权E16,300股，占出席会议股东所持股份的0.0112 %。

其中，持股份百分之五以下股东的表决情况：：同意504,491股，占出席会议持股份百分之五以下股东所持有效表决股份的80.8395%；反对102,800股，占出席会议持股份百分之五以下股东所持有效表决股份的16.5382 %；弃权E16,300股，占出席会议持股份百分之五以下股东所持有效表决股份的2.6223 %。

表决结果：本次股东大会审议通过了上述议案。

修改后的《中成进出口股份有限公司章程》、《中成进出口股份有限公司股东大会议事规则》、《中成进出口股份有限公司董事会工作条例》详见公司指定媒体巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）。

三、律师出具的法律意见

1、律师事务所名称：北京竞天公诚律师事务所

2、律师姓名：向淑芹、刘媛媛

3、结论性意见：本所律师认为，中成进出口股份有限公司本次股东大会的召集、召开程序、出席人员资格及表决程序符合现行法律、法规、规范性文件及《公司章程》的有关规定，会议形成的决议合法有效。

四、备查文件

1、中成进出口股份有限公司2014年第二次临时股东大会决议

2、北京竞天公诚律师事务所关于中成进出口股份有限公司2014年第二次临时股东大会有关事宜的法律意见书

特此公告。

中成进出口股份有限公司董事会

二〇一四年十一月一日

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。

基金管理人将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、备选成份资产的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）标的指数的成份股日常跟踪

当成份股发生增发、分红、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行为对指数的影响，适时进行组合调整分析，及时调整股票投资组合。

（2）标的指数的跟踪与分析

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

（3）申赎跟踪管理

跟踪本基金申购和赎回信息，分析其对组合的影响。

（4）投资组合的整合：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日指数的成份股及其权重为基础，根据上市公司公告，考虑T-1日可能发生的上市公司变动情况，设计T-1日的申购赎回清单并公布。

6、定期调整投资组合

基金管理人将对投资组合进行管理，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，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的表现的偏离，并对跟踪误差等进行分析，确定跟踪误差来源，优化指数跟踪效率。

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评估；

（3）每月末，基金跟踪偏离度评估通过分析本基金跟踪偏离度和跟踪误差产生原因，跟踪的控制情况，标的指数的编制成份股前后的操作，以及成份股未来成份股的变化等。

定期跟踪结束后，在正常市场条件下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.1%，年跟踪误差率不超过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跟踪偏离度，跟踪误差进一步缩小。

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，或由指数编制方法等发生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的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10月13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至2014年6月30日（“报告期末”）。

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
1	权益投资	151,462,086.87	97.23
	其中：股票	151,462,086.87	97.23
2	固定收益投资	—	—
	其中：国债	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
6	其他资产	—	—
7	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
8	合计	155,771,700.59	100.00

注：股票投资的公允价值包含可替代资产估值增值。

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	14,720,801.89	9.47
C	制造业	8,791,627.76	5.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	金融业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	4,562,002.47	2.94
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息技术、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	116,202,102.18	74.76
K	房地产业	7,185,552.57	4.62
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	国防军工业	—	—
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		151,462,086.87	97.45

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	373,571	14,696,283.14	9.46
2	600016	民生银行	2,092,904	12,996,933.84	8.36
3	600036	招商银行	1,259,206	12,924,269.44	8.30
4	600030	中信证券	1,113,789	12,624,019.94	8.21
5	601166	兴业银行	893,547	8,962,276.41	5.77
6	600090	浦发银行	876,662	7,933,971.00	5.10
7	601039	建设银行	1,530,534	6,321,105.42	4.07
8	601328	交通银行	1,599,448	6,206,342.24	3.99
9	601288	农业银行	2,024,847	5,102,614.44	3.28
10	601601	中国光大	248,372	4,418,537.88	2.84

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序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序的前五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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 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。

9.2 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。

10、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。

11、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。

10.3 本基金投资国债期货的投资价格

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。