海富通上证周期行业50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

（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

海富通上证周期行业50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28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2014年9月28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
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。

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。

魏海诺（Bruno Weil）先生，监事，法国籍，博士。历任巴黎银行东南亚负责人、亚洲融资项目副经理，法国巴黎银行跨国企业全球业务客户经理、亚洲金融机构投行业务部负责人、零售部中国代表，南京银行副行长。现任法国巴黎银行集团（中国）副董事长。

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，历任稽核经理、监察稽核总监，现任总经理助理兼上海富诚海富通资产管理有限公司监事。

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月起任海富通基金管理有限公司基金运营总监，现任总经理助理兼上海富诚海富通资产管理有限公司中后台运营总监。

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。

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。2014年9月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事、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。

孟辉先生，副总经理，硕士。历任沈阳远东证券总经理，闽发证券有限公司上海管理总部副总经理、上海清算组负责人，民生证券研究所所长助理、区域销售总监，国金证券股份有限公司销售副总监，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月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

戴德舜先生，副总经理，硕士。历任天同证券有限责任公司分析师，中银国际证券有限公司分析师，2004年3月加入海富通基金管理有限公司，历任股票分析师、组合经理、研究总监、股票绝对收益组合总监、投资总监。2014年11月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

何树方先生，副总经理，博士。历任山东济宁市财政贸易委员会副科长，魁北克蒙特利尔大学研究助理（兼职），魁北克公共退休金管理投资公司分析师、基金经理助理，富国基金管理有限公司总经理助理，2011年6月加入海富通基金管理有限公司，任总经理助理。2014年11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；戴德舜，副总经理；邵佳民，总经理助理；丁俊，投资副总监；杜晓海，定量及风险管理总监，兼任上海富诚海富通资产管理有限公司投资总监。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：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
联系人：张静
客户服务电话：95533
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：田国立
电话：010-66596688
传真：010-66593777
客户服务电话：95566
网址：www.boc.cn

（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：李建红
客户服务电话：95555
联系人：邓炯鹏
网址：www.cmbchina.com

（7）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

（8）中国光大银行股份有限公司
地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
法定代表人：唐双宁
客户服务电话：95595（全国）
联系人：李伟
网址：www.cebbank.com

（9）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

（10）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/

（11）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：洪崎
客户服务电话：95568
网址：www.cmbc.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
客服电话：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）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

（21）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

（22）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

（23）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：杨泽柱
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

（24）中银国际证券有限责任公司
地址：上海市浦东银城中路200号中银大厦39层
法定代表人：许刚
客户服务电话：400-6208-888，021-61195566
联系人：吕品
网址：www.bocichina.com.cn

（25）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

（26）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

（27）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：95548
联系人：吴忠超
网址：www.zxwt.com.cn

（28）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：杨树财
客户服务电话： 4006000686
联系人： 潘锴
网址：www.nesc.cn

（29）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

（30）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

（31）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

（32）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

（33）第一创业证券股份有限公司
地址：深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
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

（34）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/

（35）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

（36）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

（37）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

（38）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

（39）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

（40）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

（41）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

（42）财富证券有限责任公司
办公地址：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
联系人：郭磊
电话：0731－84403360
公司网站:www.cfzq.com

（43）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

（44）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

（45）山西证券股份有限公司
办公地址：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
联系人：张治国
客服电话：400-666-1618
公司网站：www.i618.com.cn

（46）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
联系人：赵明
客服电话：4006198888
公司网站：www.mszq.com

（47）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

（48）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

（49）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

（50）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：赵文安
客户服务电话：4008698698
联系人：李欣
网址： www.ydsc.com.cn

（51）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

（52）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： www.hlzqgs.com

（53）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

（54）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

（55）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

（56）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

（57）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：黄莹
网址：www.sywg.com

（58）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：周志茹
网址：www.hx168.com.cn

（59）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：童彩平
网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

（60）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

（61）上海好买基金销售有限公司
地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
法定代表人：杨文斌
客户服务电话：400-700-9665
联系人：张茹
网址：www.ehowbuy.com

（62）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：单丙烨
客服电话：400-089-1289
公司网站： www.erichfund.com

（63）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７６５０号２０５室
法定代表人：汪静波
客户服务电话：400－821－5399
联系人：徐诚
网址： www.noah-fund.com

（64）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：潘世友
网址： www.1234567.com.cn

（65）?和讯信息科技有限公司
地址：上海市浦东新区东方路18号保利广场E座18F
法定代表人： 王莉
客户服务电话：400-920-0022
联系人：吴卫东
网址： licaike.hexun.com

（66）?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：翟飞飞
网址： www.myfund.com

（67）?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

（68）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：王斐
客户服务电话: 400-081-6655
联系人：顾欣
网址：www.wy-fund.com

（69）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
法定代表人：陈操
地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006室
联系人：刘宝文
客户服务电话：400-850-7771
网站：https://t.jrj.com/

3、场内销售机构

具有开放式基金销售资格的、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
法定代表人：周明
电话：010-50938835
传真：010-50938907
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：021-3135 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：海富通上证周期行业50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

本基金的投资目标为：通过投资于上证周期行业50ETF，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

本基金投资于上证周期行业50ETF、上证周期行业50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。其中投资于上证周期行业50ETF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周期行业50ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数的表现。建仓完成后，正常情况下投资于上证周期行业50ETF的比例不低于基金资产净值的90%。

本基金投资于上证周期行业50ETF的方式以申购和赎回为主，但在上证周期行业50ETF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，投资于上证周期行业50ETF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。

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。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：上证周期行业50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、或上证周期行业50指数的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。

十、基金的风险收益特征

本基金属股票型基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，具有与上证周期行业50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2014年10月17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6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	103,601,039.01	94.35
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,194,342.12	5.64
8	其他资产	6,600.58	0.01
9	合计	109,801,981.71	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	上证周期行业50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	103,601,039.01	94.72

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。

9、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。

10、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

10.1 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。

10.2 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。

11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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。

12、投资组合报告附注

12.1 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。

12.2 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。

12.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,241.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,161.27
5	应收申购款	198.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,600.58

12.4 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。

12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2014年6月30日。

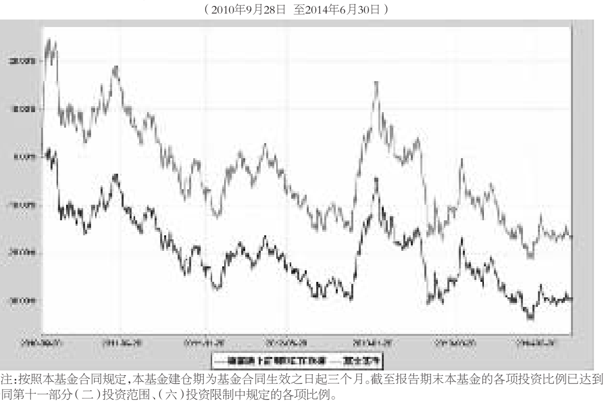
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（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)
2010年9月28日至2010年12月31日	-12.40%	1.39%	7.36%	1.83%	-19.76%	-0.44%
2011年1月1日至2011年12月31日	-16.32%	1.20%	-17.42%	1.27%	1.10%	-0.07%
2012年1月1日至2012年12月31日	16.37%	1.14%	16.21%	1.20%	0.16%	-0.06%
2013年1月1日至2013年12月31日	-13.25%	1.57%	-14.30%	1.59%	1.05%	-0.02%
2014年1月1日至2014年6月30日	-4.46%	1.01%	-5.37%	1.04%	0.91%	-0.03%
自基金合同生效起至2014年6月30日	-29.30%	1.28%	-16.45%	1.36%	-12.85%	-0.08%

（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28日 至2014年6月30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、基金的证券交易费用；
8、基金的银行汇划费用；
9、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

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取0）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-所持有目标ETF份额所对应的资产净值后的余额，若为负数，则E取0

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

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.1%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-所持有目标ETF份额所对应的资产净值后的余额，若为负数，则E取0

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。

上述“一、基金费用的种类”中第4－9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、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，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

海富通上证周期行业50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.删除了谷若鸿（Laurent Couraudon）先生的简历并新增了魏海诺（Bruno Weil）先生的简历。
2.删除了王明权先生、陈洪先生的简历。
3.更新了奚万荣先生、高勇前先生、阎小庆先生的简历。
4.新增了孟辉先生、戴德舜先生、何树方先生的简历。
5.更新了投资决策委员会名单及相关信息。

二、“第四节 基金托管人”部分：对基金托管人的主要人员情况、基金托管业务经营情况及基金托管人的内部控制制度进行了更新。

三、“第五节 相关服务机构”部分：

1.场外销售机构：
（1）新增深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为场外销售机构。
（2）对部分场外销售机构的相关信息进行了更新。

2. 注册登记人：
更新了注册登记人的电话及传真号码信息。

四、“第八节 基金份额的申购与赎回”部分，更新了“（五）申购与赎回的数额限制”的内容。

五、“第九节 基金的投资”和“第十节 基金的业绩”部分，根据2014年第二季度报告，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2014年6月30日。

海富通基金管理有限公司
2014年11月11日

海富通双福分级债券型证券投资基金之A份额申购与赎回结果的公告

根据海富通双福分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）《基金合同》、《招募说明书》的规定，海富通基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”） 已于2014年10月30日于证监会指定媒体及本公司网站（www.hftfund.com） 发布了《海富通双福分级债券型证券投资基金之A份额开放申购、赎回业务的公告》（简称 “《开放公告》”）。此次为海富通双福分级债券型证券投资基金（以下简称“本基金”） 之A份额（以下简称“双福A”）在第一个运作周期内A份额（以下简称“双福A”）的第1个开放期，现将双福A申购、赎回结果公告如下：

??一、本次双福A开放申购与赎回的确认结果

2014年11月5日为此次双福A的赎回开放日，根据《开放公告》的规定，所有经确认有效的双福A的赎回申请全部予以成交确认，据此确认的双福A赎回总份额为263,282,480.98份。

根据《开放公告》的规定，2014年11月6日、7日、10日三个工作日开放双福A的申购业务，在任一申购开放日末双福 A 份额等于或超过双福 B 份额的 7/3 倍时，则此次双福A的申购开放期结束。

经本公司统计，截至2014年11月7日，双福A的有效申购申请总额为269,486,515.69元。本次双福A的全部有效申购申请经确认后，双福A的份额余额大于7/3倍双福B的份额余额。因此，2014年11月7日为双福A的申购结束日（以下简称“L日”），2014年11月10日不再接受双福A的申购申请。基金管理人已对投资者于2014年11月6日提交的双福A有效申购申请进行了全部确认，对投资者于2014年11月7日提交的双福A的有效申购申请按照《基金合同》的规定进行比例确认。

双福A的L日申购申请确认比例＝（7/3×双福B的L日份额余额-双福A的L日份额余额）×双福A的L日份额净值/双福A的L日有效申购申请金额

根据上式计算的双福A的L日申购申请确认比例为77.22%。

因申购申请发生比例确认的，不受本基金单笔最低申购金额的限制；未予确认的申购申请金额，由销售机构负责办理退款，请申购双福A的投资者留意资金到账情况。

截至2014年11月10日，本基金管理人已根据上述原则对本次双福A的申购与赎回申请进行了确认，并为投资者办理了有关份额权益的注册登记变更手续。投资者可于2014年11月11日起到各销售网点查询申购与赎回的确认情况。投资者赎回申请成功后，本基金管理人将自赎回申请日起7 个工作日内通过相关销售机构将赎回款项划往基金份额持有人账户。

本次双福A开放申购与赎回结束后，海富通双福分级债券型证券投资基金的总份额为507,410,034.51份，其中，双福A总份额为355,186,094.72份，双福B的基金份额未发生变化，仍为152,223,939.79份，双福A与双福B的份额配比为6.99993894：3。

风险提示：

基金管理人承诺以诚实信用、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。投资者投资于本基金时应认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》等相关法律文件。

投资者可拨打本公司的客户服务电话400-884-0099 或登录本公司网站www.hftfund.com 了解详细情况。

特此公告。

海富通基金管理有限公司
2014年11月11日