

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
信息披露日期:二〇一五年三月三十日

1.1 重要提示
基金管理人承诺:遵守法律法规,恪守基金管理人职责,诚实守信、勤勉尽责,按照合同约定,及时、准确、完整地提供相关信息,并承担相应的法律责任。
基金管理人:中国工商银行股份有限公司
基金托管人:海富通基金管理有限公司

2.1 基金基本情况
基金简称:海富通上证非周期ETF联接
基金代码:519002
交易代码:519002

2.2 基金产品说明
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的最小化。
投资策略:本基金主要投资于上证非周期行业100ETF,跟踪标的指数的表现,并采用多种投资策略进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数的表现。
业绩比较基准:上证非周期行业100指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%

2.3 基金管理人及基金托管人
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
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

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
2014年 2013年 2012年
本期已实现收益 -3,635,702.57 -9,337,058.58 -17,134,495.81
本期公允价值变动收益 29,328,516.34 7,428,567.77 -1,597,883.99

3.1.2 期末数据和指标
2014年末 2013年末 2012年末
期末基金份额净值 78.05519683 109,515,620.03 146,798,391.16
期末基金资产净值 78,055,196.83 109,515,620.03 146,798,391.16

3.2 基金业绩比较基准
3.2.1 业绩比较基准
3.2.2 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益变动的比较
3.2.3 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益变动的比较

3.3 基金投资组合报告
3.3.1 基金投资组合报告
3.3.2 基金投资组合报告
3.3.3 基金投资组合报告

3.4 基金管理人报告
3.4.1 基金管理人及基金托管人
3.4.2 基金管理人及基金托管人
3.4.3 基金管理人及基金托管人

3.5 基金投资组合报告
3.5.1 基金投资组合报告
3.5.2 基金投资组合报告
3.5.3 基金投资组合报告

3.6 基金投资组合报告
3.6.1 基金投资组合报告
3.6.2 基金投资组合报告
3.6.3 基金投资组合报告

3.7 基金投资组合报告
3.7.1 基金投资组合报告
3.7.2 基金投资组合报告
3.7.3 基金投资组合报告

3.8 基金投资组合报告
3.8.1 基金投资组合报告
3.8.2 基金投资组合报告
3.8.3 基金投资组合报告

3.9 基金投资组合报告
3.9.1 基金投资组合报告
3.9.2 基金投资组合报告
3.9.3 基金投资组合报告

3.10 基金投资组合报告
3.10.1 基金投资组合报告
3.10.2 基金投资组合报告
3.10.3 基金投资组合报告

3.11 基金投资组合报告
3.11.1 基金投资组合报告
3.11.2 基金投资组合报告
3.11.3 基金投资组合报告

3.12 基金投资组合报告
3.12.1 基金投资组合报告
3.12.2 基金投资组合报告
3.12.3 基金投资组合报告

3.13 基金投资组合报告
3.13.1 基金投资组合报告
3.13.2 基金投资组合报告
3.13.3 基金投资组合报告

3.14 基金投资组合报告
3.14.1 基金投资组合报告
3.14.2 基金投资组合报告
3.14.3 基金投资组合报告

3.15 基金投资组合报告
3.15.1 基金投资组合报告
3.15.2 基金投资组合报告
3.15.3 基金投资组合报告

3.16 基金投资组合报告
3.16.1 基金投资组合报告
3.16.2 基金投资组合报告
3.16.3 基金投资组合报告

3.17 基金投资组合报告
3.17.1 基金投资组合报告
3.17.2 基金投资组合报告
3.17.3 基金投资组合报告

3.18 基金投资组合报告
3.18.1 基金投资组合报告
3.18.2 基金投资组合报告
3.18.3 基金投资组合报告

3.19 基金投资组合报告
3.19.1 基金投资组合报告
3.19.2 基金投资组合报告
3.19.3 基金投资组合报告

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

2014 年度 报告摘要

2014年12月31日

本报告为年度报告摘要,不构成投资建议。
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

4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析
报告期内,本基金管理人秉承“稳健投资、长期持有”的投资理念,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。
投资策略:本基金主要投资于上证非周期行业100ETF,跟踪标的指数的表现,并采用多种投资策略进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数的表现。

4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2014年12月31日,本基金基金份额净值为78.05519683元,较期初增长2.02%。
业绩比较基准:上证非周期行业100指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%

4.3 基金投资组合报告
4.3.1 基金投资组合报告
4.3.2 基金投资组合报告
4.3.3 基金投资组合报告

4.4 基金投资组合报告
4.4.1 基金投资组合报告
4.4.2 基金投资组合报告
4.4.3 基金投资组合报告

4.5 基金投资组合报告
4.5.1 基金投资组合报告
4.5.2 基金投资组合报告
4.5.3 基金投资组合报告

4.6 基金投资组合报告
4.6.1 基金投资组合报告
4.6.2 基金投资组合报告
4.6.3 基金投资组合报告

4.7 基金投资组合报告
4.7.1 基金投资组合报告
4.7.2 基金投资组合报告
4.7.3 基金投资组合报告

4.8 基金投资组合报告
4.8.1 基金投资组合报告
4.8.2 基金投资组合报告
4.8.3 基金投资组合报告

4.9 基金投资组合报告
4.9.1 基金投资组合报告
4.9.2 基金投资组合报告
4.9.3 基金投资组合报告

4.10 基金投资组合报告
4.10.1 基金投资组合报告
4.10.2 基金投资组合报告
4.10.3 基金投资组合报告

4.11 基金投资组合报告
4.11.1 基金投资组合报告
4.11.2 基金投资组合报告
4.11.3 基金投资组合报告

4.12 基金投资组合报告
4.12.1 基金投资组合报告
4.12.2 基金投资组合报告
4.12.3 基金投资组合报告

4.13 基金投资组合报告
4.13.1 基金投资组合报告
4.13.2 基金投资组合报告
4.13.3 基金投资组合报告

4.14 基金投资组合报告
4.14.1 基金投资组合报告
4.14.2 基金投资组合报告
4.14.3 基金投资组合报告

4.15 基金投资组合报告
4.15.1 基金投资组合报告
4.15.2 基金投资组合报告
4.15.3 基金投资组合报告

4.16 基金投资组合报告
4.16.1 基金投资组合报告
4.16.2 基金投资组合报告
4.16.3 基金投资组合报告

4.17 基金投资组合报告
4.17.1 基金投资组合报告
4.17.2 基金投资组合报告
4.17.3 基金投资组合报告

4.18 基金投资组合报告
4.18.1 基金投资组合报告
4.18.2 基金投资组合报告
4.18.3 基金投资组合报告

4.19 基金投资组合报告
4.19.1 基金投资组合报告
4.19.2 基金投资组合报告
4.19.3 基金投资组合报告

4.20 基金投资组合报告
4.20.1 基金投资组合报告
4.20.2 基金投资组合报告
4.20.3 基金投资组合报告

4.21 基金投资组合报告
4.21.1 基金投资组合报告
4.21.2 基金投资组合报告
4.21.3 基金投资组合报告

8.4 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
金额单位:人民币元

Table with 5 columns: 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(%)

注:投资者需要了解本报告期内基金的投资所披露的定期报告,并阅读基金管理人网站www.hftfund.com网站的年度报告正文。

8.5 报告期内股票投资组合的重大变动
8.5.1 买入股票的成本及占比
8.5.2 卖出股票的成本及占比

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注:“买入金额”指买入成交金额(成交均价乘以成交数量)总额,不含相关交易费用。

8.5.3 卖出股票的成本及占比
8.5.4 买入股票的成本及占比

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

注:“卖出金额”指卖出成交金额(成交均价乘以成交数量)总额,不含相关交易费用。

8.5.5 卖出股票的成本及占比
8.5.6 买入股票的成本及占比

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占基金资产净值比例(%)

注:“买入金额”指买入成交金额(成交均价乘以成交数量)总额,不含相关交易费用。

8.5.7 卖出股票的成本及占比
8.5.8 买入股票的成本及占比

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占基金资产净值比例(%)

注:“卖出金额”指卖出成交金额(成交均价乘以成交数量)总额,不含相关交易费用。

8.5.9 卖出股票的成本及占比
8.5.10 买入股票的成本及占比

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占基金资产净值比例(%)

注:“买入金额”指买入成交金额(成交均价乘以成交数量)总额,不含相关交易费用。

8.5.11 卖出股票的成本及占比
8.5.12 买入股票的成本及占比

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占基金资产净值比例(%)

注:“卖出金额”指卖出成交金额(成交均价乘以成交数量)总额,不含相关交易费用。

8.5.13 卖出股票的成本及占比
8.5.14 买入股票的成本及占比

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占基金资产净值比例(%)

注:“买入金额”指买入成交金额(成交均价乘以成交数量)总额,不含相关交易费用。

8.5.15 卖出股票的成本及占比
8.5.16 买入股票的成本及占比

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占基金资产净值比例(%)

注:“卖出金额”指卖出成交金额(成交均价乘以成交数量)总额,不含相关交易费用。

8.5.17 卖出股票的成本及占比
8.5.18 买入股票的成本及占比

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占基金资产净值比例(%)

注:“买入金额”指买入成交金额(成交均价乘以成交数量)总额,不含相关交易费用。

8.5.19 卖出股票的成本及占比
8.5.20 买入股票的成本及占比

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占基金资产净值比例(%)

注:“卖出金额”指卖出成交金额(成交均价乘以成交数量)总额,不含相关交易费用。

8.5.21 卖出股票的成本及占比
8.5.22 买入股票的成本及占比

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占基金资产净值比例(%)

注:“买入金额”指买入成交金额(成交均价乘以成交数量)总额,不含相关交易费用。

8.5.23 卖出股票的成本及占比
8.5.24 买入股票的成本及占比

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占基金资产净值比例(%)

注:“卖出金额”指卖出成交金额(成交均价乘以成交数量)总额,不含相关交易费用。

8.5.25 卖出股票的成本及占比
8.5.26 买入股票的成本及占比

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占基金资产净值比例(%)

注:“买入金额”指买入成交金额(成交均价乘以成交数量)总额,不含相关交易费用。

8.5.27 卖出股票的成本及占比
8.5.28 买入股票的成本及占比

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占基金资产净值比例(%)

注:“卖出金额”指卖出成交金额(成交均价乘以成交数量)总额,不含相关交易费用。

8.5.29 卖出股票的成本及占比
8.5.30 买入股票的成本及占比

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占基金资产净值比例(%)

注:“买入金额”指买入成交金额(成交均价乘以成交数量)总额,不含相关交易费用。

8.5.31 卖出股票的成本及占比
8.5.32 买入股票的成本及占比

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占基金资产净值比例(%)

注:“卖出金额”指卖出成交金额(成交均价乘以成交数量)总额,不含相关交易费用。

8.5.33 卖出股票的成本及占比
8.5.34 买入股票的成本及占比

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占基金资产净值比例(%)

注:“买入金额”指买入成交金额(成交均价乘以成交数量)总额,不含相关交易费用。