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

（2018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。

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等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策。基金管理人提醒投资人基金投资的"买者自负"原则,在作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。

本招募说明书所载内容截止日为2018年9月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2018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%、法国巴黎资产管理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。历任交通银行河南省分行铁道支行行长、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。

任志强先生,董事,总经理,硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理,华宝信托投资有限责任公司研究发展中心总经理兼投资管理部总经理、华宝信托投资有限责任公司总裁助理兼董事会秘书,华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。华宝兴业基金管理有限公司基金经理、投资总监、副总经理,华宝兴业资产管理（香港）有限公司董事长。2017年6月加入海富通基金管理有限公司,现任海富通基金管理有限公司董事、总经理。2018年3月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事长。

杨明先生,董事,管理学学士。历任中国人民银行新余支行科员,交通银行新余支行办公室科员、证券业务部负责人、证券业务部副主任、证券业务部主任,海通证券有限公司新余营业部总经理,海通证券股份有限公司江苏分公司筹备负责人、总经理、党委副书记,现任海通证券股份有限公司人力资源部总经理、党委组织部部长。

吴淑琨先生,董事,管理学博士。历任南京大学副教授,海通证券股份有限公司研究所宏观研究部经理、所长助理、机构业务部副总经理、企业及私人客户服务部副总主持、企业金融部总经理。现任海通证券股份有限公司战略发展部总经理。

Ligia Torres（陶乐斯）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月至今任法国巴黎资产管理公司亚太区CEO。

Alexandre Werno(韦历山)先生, 董事,金融硕士学位。2007年9月至2013年4月在法国兴业投资银行全球市场部任执行董事、中国业务开发负责人职务;2013年5月至2017年11月先后任华宝兴业基金管理有限公司总经理高级顾问、常务副总经理职务;2017年11月至今任法国巴黎资产管理亚洲有限公司亚太区战略合作总监。

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。

Marc Bayot（巴约特）先生,独立董事,比利时籍,布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学金融学荣誉教授,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、Degroof资产管理（布鲁塞尔）独立董事,现任 Pioneer投资公司（米兰,都柏林,卢森堡）独立董事、Fundconnect独立董事长和法国巴黎银行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。

张馨先生,独立董事,博士。历任厦门大学经济学院财金系教授及博士生导师、副院长兼系主任、厦门大学经济学院院长。2011年1月至今退休。

杨仓兵先生,监事长,管理学学士。历任安徽省农业科学院计财科副科长,安徽示康药业有限公司财务部干部、经理,海通证券股份有限公司计划财务部干部、计划资金部资金科科长、计划资金部总经理助理、计划资金部副总经理,上海海振实业发展有限公司总经理,海通证券股份有限公司计划财务部副总经理。自2015年10月至今任海通证券股份有限公司资金管理总部总经理。

Bruno Weil（魏海诺）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。

俞涛先生,监事,博士,CFA。先后就职于上投摩根基金管理有限公司、摩根资产管理（英国）有限公司。曾任上投摩根基金管理有限公司业务发展部总监。2012年11月加入海富通基金管理有限公司,历任产品与创新总监。2015年12月起任海富通基金管理有限公司总经理助理。

奚万荣先生,督察长,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,历任监事、监察稽核总监、总经理助理。2015年7月起，任海富通基金管理有限公司督察长。2015年7月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司监事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。

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经理。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。

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。

江勇先生,经济学硕士。历任国泰君安期货有限公司研究所高级分析师,资产管理部研究员、交易员、投资经理。2017年6月加入海富通基金管理有限公司。2018年7月起任海富通上证周期ETF、海富通上证周期ETF联接、海富通上证非周期ETF、海富通上证非周期ETF联接、海富通中证100指数(LOF)、海富通中证内地低碳指数的基金经理。

纪君凯先生,上海财经大学统计学硕士,历任天风证券上海自营分公司衍生品部投资研究、期权交易职位。2017年7月加入海富通基金管理有限公司,任投资经理。2018年7月起任海富通上证周期ETF联接的基金经理助理。

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;刘璎女士,任职时间为2010年11月至2018年8月。。

投资决策委员会常设委员有:任志强,总经理;胡光涛,总经理助理;王智慧,总经理助理;孙海忠,总经理助理兼固定收益投资总监;杜晓海,量化投资部总监;王金祥,研究部总监;陈轶平,固定收益投资副总监;赵赫,年金权益投资总监。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:易会满
注册资本:人民币35,640,625.71万元
联系电话:010-66105799
联系人:郭明

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
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:易会满
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号
客户服务中心电话:95588
联系人:刘秀宇
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
法定代表人:田国立
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
客户服务电话:95533
联系人:张静
网址:www.ccb.com

（3）中国银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1 号
法定代表人:陈四清
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
客户服务电话:95566
联系人:陈洪源
网址:www.boc.cn

（4）中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:周慕冰
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
客户服务电话:95599
联系人:张伟
网址:www.abchina.com

（5）交通银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:彭纯
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
客户服务电话:95559
联系人:王菁
网址:www.bankcomm.com

（6）招商银行股份有限公司
注册地址:广东省深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:李建红
办公地址:广东省深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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
注册地址:广东省深圳市深南东路5047号
法定代表人:谢永林
办公地址:广东省深圳市深南东路 5047号
客户服务电话:95511-3
联系人:赵杨
网址:bank.pingan.com

（8）中国光大银行股份有限公司
注册地址: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
办公地址:北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
客户服务电话:95595（全国）
联系人:王博
网址:www.cebbank.com

（9）上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:高国富
办公地址:上海市中山东一路12号
客户服务电话:95528
联系人:施晓俊
网址:www.spdb.com.cn

（10）中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街9号
法定代表人:李庆萍
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街9号
客户服务电话:95558
联系人:王晓琳
网址:www.citicbank.com

（11）中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:洪崎
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
客户服务电话:95568
联系人:王志刚
网址:www.cmbc.com.cn

（12）浙商银行股份有限公司
注册地址:浙江省杭州市下城区庆春路288号
法定代表人:沈仁康
办公地址:浙江省杭州市下城区庆春路288号
客户服务电话:95527
联系人:沈崟杰
网址:www.czbank.com

（13）华夏银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦
法定代表人:李民吉
办公地址:北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦
客户服务电话:95577
联系人:张晔
网址:www.hxb.com.cn

（14）江苏江南农村商业银行股份有限公司
注册地址:江苏省常州市和平中路413号
法定代表人:陆向阳
办公地址:江苏省常州市和平中路413号
客户服务电话:0519-96005
联系人:包静
网址:www.jnbank.com.cn

（15）海通证券股份有限公司
注册地址:上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人:周杰
办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦
客户服务电话:95553或4008888001
联系人:李笑鸣
网址:www.htsec.com

（16）中信证券股份有限公司
注册地址: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:张佑君
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
客户服务电话:95548
联系人:王一通
网址:www.cs.ecitic.com

（17）光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:周健男
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
客户服务电话:95525
联系人:姚巍
网址:www.ebscn.com

（18）国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
法定代表人:杨德红
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29F
客户服务电话:95521
联系人:钟伟镇
网址:www.gtja.com

（19）中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人:王常青
办公地址:北京市东城区朝内大街188号
客户服务电话:95587或4008888108
联系人:许梦园
网址:www.csc108.com

（20）招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38至45层
法定代表人:霍达
办公地址:广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
客户服务电话:95565
联系人:林生迎
网址:www.newone.com.cn

（21）华泰证券股份有限公司
注册地址:南京市江东中路228号
法定代表人:周易
办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场
客户服务电话:95597
联系人:马艺卿
网址:www.htsc.com.cn

（22）广发证券股份有限公司
注册地址:广东省广州市越秀区东风东路713号
法定代表人:杨明生
办公地址:广东省广州市越秀区东风东路713号
客户服务电话:4008308003
联系人:刘伟
网址:www.cgbchina.com.cn

（23）长江证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市新华路特8号
法定代表人:尤习贵
办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
客户服务电话:95579或4008888999
联系人:奚博宇
网址:www.95579.com

（24）中银国际证券股份有限责任公司
注册地址:上海市浦东银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:宁敏
办公地址:上海市浦东银城中路200号中银大厦39层
客户服务电话:4006208888
联系人:许慧琳
网址:www.bocichina.com

（25）国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
客户服务电话:95536
联系人:周杨
网址:www.guosen.com.cn

（26）中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层
法定代表人:陈共炎
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
客户服务电话:4008888888或95551
联系人:辛国政
网址:www.chinastock.com.cn

（27）中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
法定代表人:姜晓林
办公地址:青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层
客户服务电话:95548
联系人:刘晓明
网址:www.zxwt.com.cn

（28）东北证券股份有限公司
注册地址:长春市生态大街6666号
法定代表人:李福春
办公地址:长春市生态大街6666号
客户服务电话:95360
联系人:安岩岩
网址:www.nesc.cn

（29）国元证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市梅山路18号
法定代表人:蔡咏
办公地址:安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座
客户服务电话:95578或4008888777
联系人:李蔡
网址:www.gyzq.com.cn

（30）德邦证券股份有限公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
法定代表人:武晓春
办公地址:上海市福山路500号城建国际中心26楼
客户服务电话:4008888128
联系人:刘熠
网址:www.tebon.com.cn

（31）中泰证券股份有限公司
注册地址:济南市市中区经七路86号
法定代表人:李玮
办公地址:山东省济南市市中区经七路86号
客户服务电话:95538
联系人:许曼华
网址:www.zts.com.cn

（32）第一创业证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
法定代表人:刘学民
办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
客户服务电话:95358
联系人:李晓伟
网址:www.firstcapital.com.cn

（33）中国中投证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
法定代表人:高涛
办公地址:广东省深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A座4层、18-21层
客户服务电话:95532或4006008008
联系人:刘毅
网址:www.china-invs.cn

（34）中国国际金融股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人:丁学东
办公地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座28层
公司总机:010-65051166（北京）;021-58796226（上海）
联系人:王少立
网址:www.cicc.com

（35）长城证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17层
法定代表人:丁益
办公地址:广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
客户服务电话:4006666888
联系人:金夏
网址:www.cgws.com

（36）方正证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路华侨国际大厦24楼
法定代表人:高利
办公地址:北京市朝阳区北四环中路盘古大观A座40层
客户服务电话:95571
联系人:程博怡
网址:www.foundersc.com

（37）华福证券有限责任公司
注册地址:福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层
法定代表人:黄金琳
办公地址:福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层
客户服务电话:0591-96326（福建）或4008896326（全国）
联系人:张腾
网址:www.hfzq.com.cn

（38）渤海证券股份有限公司
注册地址:福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层
法定代表人:黄金琳
办公地址:福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层
客户服务电话:0591-96326（福建）或4008896326（全国）
联系人:张腾
网址:www.hfzq.com.cn

（39）广州证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人:胡伏云
办公地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
客户服务电话:95396
联系人:林洁茹
网址:www.gzs.com.cn

（40）东莞证券股份有限公司
注册地址:东莞市莞城区可园南路一号
法定代表人:陈照星
办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
客户服务电话:95328
联系人:梁建伟
网址:www.dgzq.com.cn

（41）财富证券有限责任公司
注册地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
法定代表人:蔡一兵
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层
客户服务电话:95317或4008835316
联系人:郭磊
网址:www.cfzq.com

（42）江海证券有限公司
注册地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:赵洪波
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
客服电话:4006662288
联系人:周俊
网址:www.jhzq.com.cn

（43）东兴证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街5号(新盛大厦)12、15层
法定代表人:魏庆华
办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层
客户服务电话:95309
联系人:汤漫川
网址:www.dxzq.net

（44）山西证券股份有限公司
注册地址: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
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
客户服务电话:95573
联系人:张治国
网址:www.i618.com.cn

（45）民生证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16层--18层
法定代表人:冯鹤年
办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座18层
客户服务电话:4006198888
联系人:赵明
网址:www.mszq.com

（46）平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人:刘世安
办公地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
客户服务电话:95511-8
联系人:周驰
网址:stock.pingan.com

（47）上海证券有限责任公司
注册地址:上海市黄浦区四川中路213号7楼
法定代表人:李俊杰
办公地址:上海市黄浦区四川中路213号7楼
客户服务电话:4008918918
联系人:邵珍珍
网址:www.shzq.com

（48）国都证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
客户服务电话:4008188118
联系人:黄静
网址:www.guodu.com

（49）英大证券有限责任公司
注册地址: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
办公地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
客户服务电话:4000188688
联系人:王晓静
网址:www.ydsc.com.cn

（50）红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号
法定代表人:李素明
办公地址:云南省昆明市北京路155号附一号红塔大厦7-11楼
客户服务电话:4008718880
联系人:刘晓明
网址:www.hongtastock.com

（51）华龙证券股份有限公司
注册地址:兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
法定代表人:李晓安
办公地址:兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
客户服务电话:95368
联系人:范坤
网址:www.hlzq.com

（52）华宝证券有限责任公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层
法定代表人:陈林
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
客户服务电话:4008209898
联系人:刘闻川
网址:www.cnhbstock.com

（53）天相投资顾问有限公司
注册地址: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
办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座505
客户服务电话:010-66045678
联系人:谭磊
网址:jijin.txsec.com

（54）信达证券股份有限公司
注册地址: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
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
客户服务电话:95321
联系人:唐静
网址:www.cindasc.com

（55）申万宏源证券有限公司
注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层
客户服务电话:95523或4008895523
联系人:陈飙
网址:www.swhysc.com

（56）华西证券股份有限公司
注册地址:成都市高新区天府二街198号
法定代表人:杨炯洋
办公地址:成都市高新区天府二街198号
客户服务电话:95584
联系人:谢国梅
网址:www.hx168.com.cn

（57）西藏东方财富证券股份有限公司
注册地址:西藏拉萨市北京中路101号
法定代表人:陈宏
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦
客户服务电话:95357
联系人:付佳
网址:www.xzsec.com

（58）财达证券有限责任公司
注册地址:石家庄市自强路35号
法定代表人:翟建强
办公地址:河北省石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦23-26层
客户服务电话:4006128888
联系人:李卓颖
网址:www.s10000.com

（59）太平洋证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼
法定代表人:李长伟
办公地址:云南省昆明市北京路926号同德广场写字楼31楼
客户服务电话:95397
联系人:唐昌田
网址:www.tpyzq.com

（60）开源证券股份有限公司
注册地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人:李刚
办公地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
客户服务电话:95325或4008608866
联系人:袁伟涛、曹新
网址:www.kysec.cn

（61）华金证券有限责任公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路759号30层
法定代表人:宋卫东
办公地址:上海市浦东新区杨高南路759号30层
客户服务电话:4008211357
联系人:郑媛
网址:www.huajinsc.cn

（62）申万宏源西部证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人:韩志谦
办公地址:新疆乌鲁木齐高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
客户服务电话:4008000562
联系人:王怀春
网址:www.hysec.com

（63）中信期货有限公司
注册地址: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13层1301-1305、14层
法定代表人:张皓
办公地址: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13层1301-1305室、14层
客户服务电话:4009908826
联系人:刘宏莹
网址:www.citicsf.com

（64）天风证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼
法定代表人:余磊
办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
客户服务电话:93391或4008005000
联系人:岑妹妹
网址:www.tfzq.com

（65）宏信证券有限责任公司
注册地址:成都市锦江区人民南路二段十八号川信大厦10楼
法定代表人:吴玉明
办公地址:四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼
客户服务电话:4008366366
联系人:张鋆
网址:www.hxzq.cn

（66）大同证券有限责任公司
注册地址:山西省大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
法定代表人:董祥
办公地址:山西省太原市小店区长治路世贸中心12层
客户服务电话:4007121212
联系人:薛津
网址:www.dtsbc.com.cn

（67）安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人:王连志
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
客户服务电话:4008001001
联系人:陈剑虹
网址:www.essence.com.cn

（68）世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层
法定代表人:姜昧军
办公地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层
客户服务电话:4008323000
联系人:王雯
网址:www.csco.com.cn

（69）中天证券股份有限公司
注册地址:沈阳市和平区光荣街23甲
法定代表人:马功勋
办公地址:沈阳市和平区光荣街23甲
客户服务电话:95346
联系人:孙丹华
网址:www.iztzq.com

（70）东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
法定代表人:赵俊
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
客户服务电话:95531或4008888588
联系人:王一彦
网址:www.longone.com.cn

（71）深圳众禄金融控股股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801
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

（72）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室
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:李雁雯
网址:蚂蚁财富APP

（73）上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
地址:上海浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦10层
法定代表人:杨文斌
客户服务电话:400-700-9665
联系人:陆敏
网址:www.howbuy.com

（74）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:400-820-2899
公司网站: www.erichfund.com

（75）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
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:余翼飞
网址: www.noah-fund.com

（76）上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层
地址:徐汇区龙田路195号3C座7楼
法定代表人:其实
客户服务电话:400-1818-188
联系人:王超
网址: www.1234567.com.cn

（77） 和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号1002室
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:刘洋
网址: licaike.hexun.com

（78） 北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼32层3201内3212、3211单元
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:400-818-000
联系人:罗恒
网址: www.myfund.com

（79） 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:杭州市文二西路1号903室
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:董一峰
网址:www.5ifund.com

（80）众升财富（北京）基金销售有限公司
注册地址: 北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室
地址:北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室
法定代表人:李招弟
客户服务电话: 400-876-9988
联系人:付少帅
网址:www.zscffund.com

（81）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
法定代表人:陈操
注册地址:深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704
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:文雯
客户服务电话:400-850-7771
网站:http://www.bdcgw.cn

（82）一路财富（北京）信息科技有限公司
法定代表人:吴雪秀
注册地址: 北京市西城区阜成门外大街2号1幢A2208室
地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
联系人:徐越
客服电话:400-001-1566
网址:www.yilucaifu.com

（83）上海联泰资产管理有限公司
法定代表人:燕斌
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
地址:中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
客服电话:4000-466-788
联系人:陈东
http://www.66zichan.com/

（84）北京增财基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号
地址:北京市西城区南礼士路66号1号楼12层1208号
法定代表人:罗细安
客服电话:400-001-8811
联系人:史丽丽
http://www.zcvc.com.cn/

（85）北京钱景基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人:赵荣春
联系人:高静
电话:010-56183769
客服电话:400-893-6885
网址:www.qianjing.com

（86）上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市黄浦区黄河路333号201室A区056单元
地址:上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人:冯修敏
客服电话:400-820-2819
联系人:李栋
网址:www.chinapnr.com

（87）嘉实财富管理有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层
地址:上海市浦东新区世纪大道8号国金中心办公楼二期46层4609-10单元
法定代表人:赵学军
客服电话:400-021-8850
联系人:余永键
网址:http://www.harvestwm.cn/

（88）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
客服电话:400-6411-999
联系人:张晓辉
网址:http://www.taichengcaifu.com

（89）上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
法定代表人:李兴春
客服电话:400-921-7755
联系人:徐鹏
网址:http://www.leadbank.com.cn

（90）珠海盈米财富管理有限公司
注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人:肖雯
客服电话:020-89629066
联系人:吴煜浩
网址:www.yingmi.cn

（91）北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京市北京经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人:梁越
客服电话:4008-980-618
联系人:王海烨
网址:www.chtfund.com

（92）北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
法定代表人:胡伟
客服电话:400-068-1176
联系人:陈铭洲
网址:www.hongdianfund.com

（93）大泰金石基金销售有限公司
注册地址:南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
地址:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室
法定代表人:袁顾明
客服电话:400-928-2266
联系人:赵明
网址:http://www.dtfunds.com/

（94）上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元
地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人:郭坚
客服电话:4008 6666 18
联系人:程晨
网址:https:/www.lu.com

（95）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
法定代表人:沈伟桦
客服电话:400-6099-200
联系人:刘梦轩
网址:http://www.yixinfund.com/

（96）上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
法定代表人:陈继武
客服电话:4000-178-000
联系人:王哲宇
网址:www.vstonewealth.com

（97）中证金牛（北京）投资咨询有限公司
注册地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
法定代表人:彭运年
客服电话:4008-909-998
联系人:王莅晨
网址:http://www.jnlc.com/

（98）深圳富济财富管理有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位
地址:深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层
法定代表人:齐小贺
客服电话:0755-83999907
联系人:刘娜
网址:http://www.fujiwealth.cn

（99）奕丰金融服务（深圳）有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
法定代表人:TAN YIK KUAN
客服电话:400-684-0500
联系人:叶健
网址:www.ifastps.com.cn

（100）浙江金观诚财富管理有限公司
注册地址:杭州市拱墅区登云路45号(锦昌大厦)1幢10楼1001室
地址:杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室
法定代表人:徐黎云
客服电话:400-068-0058
联系人:孙成岩
网址:www.jincheng-fund.com

（101）上海大智慧财富管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
地址:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼10-11楼
法定代表人:申健
客服电话:021-20219931
联系人:施燕华
网址:https://www.gw.com.cn

（102）北京广源达信基金销售有限公司
注册地址: 北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
地址:北京市朝阳区望京东园四区13楼浦项中心B座19层
法定代表人:齐剑辉
客服电话:400-623-6060
联系人:崔丁元
网址:https://www.niuniufund.com/

（103）北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108号
地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人:王伟刚
客服电话:400-619-9059
联系人:丁向坤
网址:www.hcjijin.com

（104）厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册地址:厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室
地址: 厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504
法定代表人:陈洪生
客服电话:400-918-0808
联系人:蔡之帆
网址:www.xds.com.cn

（105）北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法定代表人:李昭琛
客服电话:010-62675369
联系人:吴翠
网址:http://finance.sina.com.cn/fund/

（106）北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址: 北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
法定代表人:陈超
客服电话:95118 / 400-098-8511
联系人:赵德赛
网址:http://fund.jd.com

（107）凤凰金信（银川）投资管理有限公司
注册地址:宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402办公用房
地址:北京市朝阳区紫月路18号院 朝来高科技产业园18号楼
法定代表人:程刚
客服电话:400-810-5919
联系人:王鹤敏
网址:www.fengfd.com

（108）深圳市金斧子投资咨询有限公司
注册地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层
地址:深圳市南山区南山街道科苑路18号东方科技大厦18F
法人代表:陈姚坚
客服电话:400-9500-888
联系人:张烨
网址:www.jfzinv.com

（109）上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
法人代表:李一梅
客服电话:400-817-5666
联系人:穆文燕
网址:www.amcfortune.com

（110）南京苏宁基金销售有限公司
注册地址: 南京市玄武区苏宁大道1-5号
地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法人代表:钱燕飞
客服电话:95177
联系人:喻明明
网址:www.snjijin.com

（111）北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法人代表:钟斐斐
客服电话:4000-618-518
联系人:侯芳芳
网址:www.danjuanapp.com

（112）上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
法定代表人:王翔
客服电话:400-820-5369
联系人:李鑫
网址:www.jiyufund.com.cn

（113）中民财富管理（上海）有限公司
注册地址: 上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
地址:上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
法人代表:弭洪军
客服电话:400-876-5716
联系人:黄鹏
网址:www.cmiwm.com

（114）上海万得基金销售有限公司
注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
地址:中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
法人代表:王廷富
客服电话:400-821-0203
联系人:徐亚丹
网址:www.520fund.com.cn

北京植信基金销售有限公司
注册地址:北京市密云县盛南路8号院2号楼106室
地址:北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号
法人代表:于龙
客服电话:4006-802-123
联系人:吴鹏
网址:www.zhixin-inv.com

（115）上海挖财基金销售有限公司
注册地址:杭州华星路96号互联网金融大厦19楼
地址:上海陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼5楼
法人代表:冷飞
客服电话:400-711-8718
联系人:孙琦
网址:挖财宝APP

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:010-50938782
传真:010-50938907
联系人:赵亦清

（三）出具法律意见书的律师事务所
名称: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:俞卫锋
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:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:李丹
经办注册会计师:薛竞、都晓燕
电话:(021) 23238888
传真:(021) 23238800
联系人:都晓燕

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（不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等）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:风险管理部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2018年10月26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2018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	17,559,887.13	93.80
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	1,156,587.26	6.18
8	其他资产	3,682.50	0.02
9	合计	18,720,156.89	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(元)	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	17,559,887.13	94.18

3 报告期末按行业分类的股票投资组合

3.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

3.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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序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序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序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。

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 本期国债期货投资政策

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 本期国债期货投资评价

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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,609.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	218.88
5	应收申购款	854.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,682.50

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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2018年6月30日。

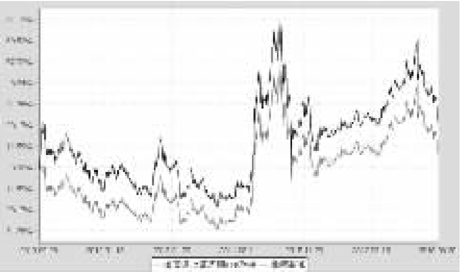
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（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12月31日	71.22%	1.45%	68.86%	1.48%	2.36%	-0.03%
2015年1月1日至2015年12月31日	-8.21%	2.33%	-10.01%	2.43%	1.80%	-0.10%
2016年1月1日至2016年12月31日	-7.31%	1.14%	-7.75%	1.19%	0.44%	-0.05%
2017年1月1日至2017年12月31日	20.41%	0.70%	21.65%	0.72%	-1.24%	-0.02%
2018年1月1日至2018年6月30日	-14.71%	1.16%	-15.08%	1.22%	0.37%	-0.06%
自基金合同生效起至2018年6月30日	10.70%	1.42%	27.87%	1.49%	-17.17%	-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28日 至2018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:

$H=E\times 0.5\%\div$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:

$H=E\times 0.1\%\div$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. 更新了任志强先生、奚万荣先生、陶网雄先生的简历。
2.增加了杨仓兵先生、江勇先生、纪君凯先生的简历。
3.删除了李础前先生、陈虹女士、章明女士、刘璎女士、金晓鸣先生的简历。
4.更新了历任基金经理的相关信息。
5.更新了投资决策委员会的相关信息。

二、"第四节 基金托管人"更新了基金托管人的相关信息。

三、"第五节 相关服务机构":更新了部分场外销售机构的相关信息。

四、"第九节 基金的投资"和"第十节 基金的业绩"部分:根据2018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2018年6月30日。

五、"二十一、对基金份额持有人的服务"部分,更新了相关服务的信息。

海富通基金管理有限公司
2018年11月10日