上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2012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：中国工商银行股份有限公司

重要提示

上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经2011年2月23日中国证券监督管理委员会证监许可［2011］268号文核准募集。本基金的基金合同于2011年4月22日正式生效。本基金类型为交易型开放式。

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：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险以及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对价的变现风险等等。本基金属股票基金，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，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，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2012年4月22日，有关财务数据和净值表现截止日为2012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：邵国有
成立时间：2003年4月18日
电话：021-38650999
联系人：包瑾
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

邵国有先生，董事长，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。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事长。

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。

艾德加（Stewart Edgar）先生，董事，英国籍，学士。历任英国Ivory & Sime公共有限公司基金经理，美国Fiduciary国际信托公司研究部主任、高级副总裁，英国HD国际有限公司高级基金经理、董事，美国F&C管理公司高级基金经理、董事，比利时富通基金管理公司董事总经理，法国巴黎投资管理公司亚太区董事总经理。

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。

张文伟先生，董事、副总经理，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。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事、副总经理。

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，现任商学院院长及经济系讲座教授。

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，Pionner投资公司独立副董事长、Fundconnect独立董事长、Degroof资产管理公司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。现任全国人大代表、全国人大财经委员会委员。

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。

余毓繁先生，监事，英国籍，工商管理荣誉学士。历任比利时通用银行香港分行资金部司库、富通银行亚洲区环球金融市场业务主管、富通银行亚洲区商人银行董事总经理，富通银行香港分行行政总裁。

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。

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，副总经理兼投资总监，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月至今任海富通基金管理有限公司投资总监兼海富通精选混合基金经理，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月任海富通精选赎回混合基金经理，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市场经理、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。

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基金基金经理助理；2007年3月至2010年6月担任华安上证180ETF基金基金经理，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基金及海富通上证周期ETF联接基金基金经理，2011年4月起兼任海富通上证非周期ETF基金及海富通上证非周期ETF联接基金基金经理。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。

投资决策委员会常设委员有：田仁灿，总经理；陈洪，副总经理兼投资总监；戴德舜，股票绝对收益组合部总监；蒋征，股票相对收益组合部总监；丁俊，研究总监；邵佳民，固定收益组合管理部总监；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）基金托管人的基本情况

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349,019,463,180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、申购赎回代理券商（简称“一级交易商”）

1）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：王开国
客户服务电话：021-95553或4008888001
联系人：李英鸣
网址：www.htsec.com

2）渤海证券股份有限公司
注册地址：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
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.bhzq.com

3）财富证券有限责任公司
地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
法定代表人：周晖
电话：0731-84403360
联系人：朱友谊
网址：www.cfzq.com

4）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

5）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或4008-888-999
联系人：李良
长江证券客户服务网站：www.95579.com

6）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：徐勇力
联系人：汤漫川
客户服务电话：4008-888-993
联系人：黄英
网址：www.dxzq.net.cn

7）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：彭博
网址：www.foundersc.com

8）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：400-8888-666
联系人：芮敏祺、吴倩
网址：www.gtja.com

9）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

10）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：凤良志
客户服务电话：0551-96888
联系人：陈琳琳
网址：www.gyzq.com.cn

11）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：0871－3577888
联系人：刘晓明
网址：www.hongtastock.com

12）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

13）江海证券有限公司
地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
客户服务电话：400-666-2288
联系人：郭玲
网址：www.jhzq.com.cn

14）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
联系人：郑舒丽
网址：www.pingan.com

15）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：孙蒙志
网址：www.qlzq.com.cn

16）兴业证券股份有限公司
地址：福建省福州市湖东路99号标力大厦
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

17）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：400-8888-111或95565
联系人：林生迎
网址：www.newone.com.cn

18）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：顾伟国
客户服务电话：4008-888-888
联系人：田薇
网址：www.chinastock.com.cn

19）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

20）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：400829898
联系人：刘坤川
网址：www.cnhhstock.com

21）中航证券有限公司
地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法定代表人：杜航
电话：4008866567
联系人：戴蕾
网址：www.sestock.com

22）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：万鸣
网址：www.htsc.com.cn

2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（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
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：金颖
电话：021-58872625
传真：021-68870311
联系人：刘永卫

（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：王利民
经办律师：秦悦民、王利民

（四）审计基金财产的会计师事务所

普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址：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
法人代表：杨绍信
经办注册会计师：汪棣、刘莉
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：上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

基金类型：股票型、交易型开放式

六、基金的投资目标

本基金的投资目标为：紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。

七、投资方向和范围

基金主要投资于标的指数成份股、各选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、各选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，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

本基金采用完全复制法跟踪标的指数，按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，进行被动式指数化投资，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。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0.1%，年跟踪误差不超过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避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

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变通和调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。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、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，基金经理以完全复制标的指数成份股及成分股权重的方法构建组合。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：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、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、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、备选成份股的资产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构建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。

② 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。

③ 申购赎回调整

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。

⑤ 剔作并公布申购、赎回清单：以T-1日指数成份股构成及其权重为基础，根据上市公司公告，考虑T日可能发生的上市公司变动情况，设计T日的申购赎回清单并公告。

6、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 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。

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0.1%，年跟踪误差不超过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避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

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非周期行业100指数。

如果指数编制单位变更或停止上证非周期行业100指数的编制及发布、或上证非周期行业100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非周期行业100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、业绩比较基准和基金名称。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属股票型基金，属于高风险、高预期收益的投资品种。本基金为指数型基金，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2012年5月10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2012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	304,346,870.37	94.71
	其中：股票	304,346,870.37	94.71
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	16,952,846.91	5.28
6	其他各项资产	45,392.70	0.01
7	合计	321,345,109.98	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,168,712.09	1.61
B	采掘业	-	-
C	制造业	183,613,898.35	57.23
C0	食品、饮料	45,008,058.09	14.03
C1	纺织、服装、皮毛	5,332,883.78	1.66
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	14,543,193.71	4.53
C5	电子	7,535,987.72	2.35
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	86,587,268.70	26.99
C8	医药、生物制品	23,668,420.35	7.38
C99	其他制造业	938,086.00	0.29
D	电力、煤气及水的生产和供应业	23,726,826.42	7.40
E	建筑业	30,779,895.51	9.59
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	28,279,361.31	8.81
H	批发和零售贸易	16,144,469.62	5.03
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	5,038,817.24	1.57
L	传播与文化产业	1,473,411.93	0.46
M	综合类	10,121,527.90	3.15
	合计	304,346,920.37	94.86

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	128,399	25,289,467.04	7.88
2	601668	中国建筑	4,269,500	13,021,975.00	4.06
3	600031	三一重工	833,008	10,221,008.16	3.19
4	600887	伊利股份	456,550	10,062,362.00	3.14
5	600050	中国联通	2,372,514	10,035,734.22	3.13
6	600104	上汽集团	642,910	9,534,355.30	2.97
7	600900	长江电力	1,365,112	8,900,530.24	2.77
8	601989	中国重工	1,259,094	7,063,517.34	2.20
9	600739	辽宁成大	382,365	6,106,369.05	1.90
10	600089	特变电工	728,850	5,619,433.50	1.75

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名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。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

8.1 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。

8.2 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。

8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	41,853.02
4	应收利息	3,539.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,392.70

8.4 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。

8.5 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不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2012年3月31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）
2011年4月22日（基金合同生效日）-2011年12月31日	-27.92%	1.22%	-32.18%	1.33%	4.26%	-0.11%
2011年4月22日（基金合同生效日）-2012年3月31日	-27.20%	1.31%	-31.36%	1.42%	4.16%	-0.11%

（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：

（2011年4月22日 至2012年3月31日）

注：1、本基金合同于2011年4月22日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、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十三章（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、基金上市费及年费；
8、基金的证券交易费用；
9、基金的银行汇划费用；
10、基金收益分配中发生的费用；
11、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的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

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、公休日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。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

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付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、标的指数许可使用费

在通常情况下，基金标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H=E×标的指数许可使用费年费率÷当年天数，根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，本基金标的指数许可使用费年费率为0.03%

H为每日应计提的基金标的指数许可使用费

E为前一日基金资产净值

自基金合同生效之日起，基金标的指数许可使用费每日计提，按季支付。根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币50,000元，当季标的指数许可使用费不足50,000元的，按照50,000元支付。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年1月、4月、7月、10月首日起10个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第4-11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、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率，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

上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资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、“第二节 释义”部分，更新了关于《销售办法》的释义。

二、第三节 基金管理人”部分：

1、更新了艾德加（Stewart Edgar）先生、郑国汉先生、巴约特（Marc Bayot）先生、杨国平先生、王明权先生、李础前先生、余毓繁先生、阎小庆先生和刘璎女士的简历；
2、更新了投资决策委员会常设委员的相关信息；

三、第四节 基金托管人”部分：更新了基金托管人的基本情况、主要人员情况以及托管业务经营情况。

四、第五节 相关服务机构”部分：

1、新增华泰证券股份有限公司为申购赎回代理券商，并对部分申购赎回代理券商信息进行了更新。
2、更新了“会计师事务所”的经办注册会计师及联系人信息。

五、第十节 基金份额的申购与赎回”部分，更新了申购赎回清单的格式。

六、第十一节 基金的投资”和“第十二节 基金的业绩”部分，根据2012年第一季度报告，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2012年3月31日。

海富通基金管理有限公司
2012年6月5日

万家添利分级债券型证券投资基金之添利A份额第二次开放申购与赎回结果的公告

万家基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）于2012年5月29日在指定媒体及本公司网站（http://www.wjasset.com）发布了《关于万家添利分级债券型证券投资基金之添利A份额第二次开放申购、赎回业务的公告》（以下简称“《开放公告》”）和《万家添利分级债券型证券投资基金之添利B份额交易风险提示公告》，并于2012年6月1日当日第二次开放添利A份额的申购与赎回业务，现将本次添利A开放申购与赎回的确认结果公告如下：

根据《开放公告》的规定，所有经确认有效的添利A的赎回申请全部予以成交确认，据此确认的添利A赎回总份额为508,168,341.05份。

根据《万家添利分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的规定，基金合同生效日起3年内，添利A的份额余额不得超过基金合同生效日添利A的初始份额（即1,862,346,429.49份）。对于添利A的申购申请，如果对全部有效的添利A的申购申请予以成交确认后，添利A的份额余额大于基金合同生效日添利A的初始份额，则以经确认后添利A份额余额不超过基金合同生效日添利A的初始份额为限，对全部有效申购申请按比例进行成交确认；否则对有效申购申请全部予以成交确认。若出现超额申购，申购申请的比例确认计算方法如下：

申购申请的确认比例=（1,862,346,429.49-（835,033,685.28-有效赎回申请份额））/比例确认前有效申购份额

投资者申购申请确认金额=投资者提交的有效申购申请金额×申购申请的确认比例

当发生比例确认时，添利A的申购申请确认金额不受申购最低限额的限制。申购申请确认金额的计算结果保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

经本基金管理人统计，2012年6月1日添利A的有效申购申请金额为2,461,704,868.66元，有效申请份额为2,355,698,452.39份，有效赎回申请总份额为508,168,341.05份。添利A的全部有效申购申请经确认后，添利A的份额余额将大于基金合同生效日添利A的初始份额，基金管理人对全部有效申购申请按比例进行成交确认。本次申购申请的确认比例为65.181563%。

综上，本基金管理人已经于2012年6月4日根据上述原则对本次添利A的申购与全部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2012年6月5日起到各销售网点查询申请与赎回的确认情况。未获成交确认的申购资金将于2012年6月4日起5个工作日内通过销售机构划往投资者指定银行账户。投资者赎回申请成功后，本基金管理人将自2012年6月4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。

本次添利A开放申购与赎回结束后，本基金的总份额为2,635,617,825.79份，其中，添利A总份额为1,862,346,414.42份，添利B的基金份额未发生变化，仍为773,271,411.37份，添利A与添利B的份额配比为2.40839941:1。

根据《基金合同》的规定，添利A自2012年6月2日（含该日）至下一开放日期间的约定年收益率根据添利A的本次开放日，即2012年6月1日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币1年期银行定期存款基准利率3.50%加上1.1%进行计算，故：

添利A的约定年收益率=3.50%+1.1%=4.60%。

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。

万家基金管理有限公司
二〇一二年六月五日

关于融通基金新增深圳众禄