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

(2015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2015年10月22日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年9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:吴晨茏

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。

邵国有先生,董事,工商管理硕士,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,海通证券投资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年至今任海通证券投资有限公司副总裁。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2014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。

简伟信(Vincent Camerlynck)先生,董事,比利时国籍,国际政治学硕士,历任CL Global Partners(纽约)副总经理、汇丰投资银行(伦敦)副总经理、高盛投资银行(伦敦及巴黎)董事总经理、法国巴黎投资管理有限公司(伦敦)疗政总裁兼董事,2012年9月至今任法国巴黎投资管理亚洲有限公司(香港)亚太区行政总裁。

刘颖先生,董事、总经理,英国籍,工商管理硕士。历任英国伦敦洛希尔父子有限公司投资银行助理,路透伦敦资产管理战略企划部全球总监,路透香港亚太区资产管理及研究总监,香港景顺投资管理有限公司驻北京办事处首席代表,景顺长城基金管理有限公司常务副总裁,德意志资产管理大中华区董事总经理。2015年3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。

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,先锋投资(卢森堡)有限公司独立董事、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 Control 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,教授。1984年7月至今任职于厦门大学经济学院,历任厦门大学经济学院教授、副院长兼财政系主任、院长,现任厦门大学经济学院教授、博士生导师。

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。

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月至今任海富通基金管理有限公司产品与创新总监。

陈虹女士,监事,法学士。历任香港的近律师事务所上海代表处律师,工银安盛人寿保险有限公司高级法律顾问,现任海富通基金管理有限公司高级法务经理。

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兼上海富诚海富通资产管理有限公司监事。

章明女士,副总经理,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4月至2015年7月任海富通基金管理有限公司督察长,2015年7月起任海富通基金管理有限公司副总经理。

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。

戴德峥先生,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。

金晓鸣先生,经济学学士。2008年7月加入海富通基金管理有限公司,先后在运营部和权益投资部任职。2014年11月起任上证非周期ETF、海富通上证非周期ETF联接、上证周期ETF、海富通上证周期ETF联接的基金经理助理。

投资决策委员会常设委员有:刘颖,总经理;戴德峥,副总经理;邵佳民,总经理助理;丁俊,投资副总监;杜晓海,量化投资部总监,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35,640,625.71万元

联系电话:010-66105799

联系人:洪渊

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

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

2)渤海证券股份有限公司

注册地址:天津市南开区宾水西道8号

法定代表人:王春峰

客户服务电话:400-651-5988

联系人:王兆权

网址:www.ewww.com.cn

3)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26,27层

法定代表人:蔡一兵

电话:400-88-35316@ 联系人:郭磊

网址:www.cfzq.com

4)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: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: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

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:魏庆华

客户服务电话:4008-888-993

联系人:黄英

网址:www.dxzq.net

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:何其聪

客户服务电话:95571

联系人:郭军瑞

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:95521

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:安徽省合肥市梅山路18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

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:4008718880

联系人:刘晓明

网址:www.hongtastock.com

12)申万宏源证券有限公司

地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

法定代表人:李梅

客户服务电话:95523、4008895523

联系人:黄莹

网址:www.swhysc.com

13)江海证券有限公司

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:刘爽

客服电话:400-666-2288

网址:www.jhzq.com.cn

14)平安证券有限责任公司

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:谢永林

客户服务电话:95511转8

联系人:吴琼

网址:stock.pingan.com

15)中泰证券股份有限公司

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268号

法定代表人:兰荣

客户服务电话:95562

联系人:谢商得

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: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:陈有安

客户服务电话:4008-888-888

联系人:宋明

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:4008209898

联系人:刘闻川

网址:www.cnhbstock.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:王宜四

电话:4008866567

联系人:戴蕾

网址:www.scstock.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:肖亦兮

网址:www.htsc.com.cn

23)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

电话:95558

联系人:顾凌

网址:www.cs.ecitic.com

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:周明

电话:021-58872625

传真:021-68870311

联系人:刘永卫

(三)相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:021-31358600

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

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:陈玲、黄靖婷

电话:(021)23238888

传真:(021)23238800

联系人:黄靖婷

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、备选成份股。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、备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操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制作并公布申购、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2015年11月19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2015年9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	40,492,501.76	94.99
	其中:股票	40,492,501.76	94.99
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,108,636.79	4.95
7	其他资产	27,454.53	0.06
8	合计	42,628,593.08	100.00

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	338,162.58	0.80
B	采矿业	-	-
C	制造业	21,933,534.84	51.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,492,493.80	12.99
E	建筑业	5,637,988.72	13.33
F	批发和零售业	1,658,973.69	3.92
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,150,922.22	9.82
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	331,760.00	0.78
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	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	948,665.91	2.24
S	综合	-	-
	合计	40,492,501.76	95.76

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	600900	长江电力	135,030	1,937,680.50	4.58
2	601766	中国中车	147,125	1,908,211.25	4.51
3	600887	伊利股份	103,370	1,589,830.60	3.76
4	601989	中国重工	156,206	1,563,622.06	3.70
5	601668	中国建筑	227,182	1,313,111.96	3.11
6	600519	贵州茅台	6,575	1,251,288.25	2.96
7	601390	中国中铁	97,859	1,070,577.46	2.53
8	600104	上汽集团	57,850	971,880.00	2.30
9	600637	东方明珠	29,145	904,369.35	2.14
10	600050	中国联通	150,271	903,128.71	2.14

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。

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 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。

10.2 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。

10.3 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。

11 投资组合报告附注

11.1 报告期内本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或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

11.2 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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11,958.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	372.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,124.17
8	其他	-
9	合计	27,454.53

11.4 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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600900	长江电力	1,937,680.50	4.58	重大事项

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2015年9月30日。

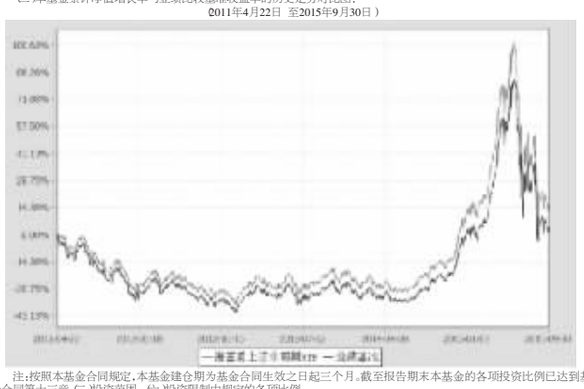
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(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①①	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%
2012年1月1日-2012年12月31日	0.23%	1.22%	-0.67%	1.28%	0.90%	-0.06%
2013年1月1日至2013年12月31日	6.01%	1.26%	4.72%	1.28%	1.29%	-0.02%
2014年1月1日至2014年12月31日	41.42%	1.14%	39.61%	1.15%	1.81%	-0.01%
2015年1月1日至2015年6月30日	46.36%	2.30%	45.22%	2.38%	1.14%	-0.08%
2011年4月22日(基金合同生效日)-2015年9月30日	14.25%	1.63%	2.27%	1.70%	11.98%	-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:

(2011年4月22日 至2015年9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、公休假等,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取。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、第三节"基金管理人"部分;

1.增加了陈虹女士的简历。

2.更新了邵国有先生、巴约特(Marc Bayot)先生、奚万荣先生、章明女士的简历。

3.删除了孟辉先生的简历。

4.更新了投资决策委员会的相关信息。

二、第四节"基金托管人"部分;更新了基金托管人的相关信息。

三、第五节"相关服务机构"部分;

1.对部分申购赎回代理券商(简称"一级交易商")信息进行了更新。

2.更新了审计基金财产的会计师事务所的信息。

四、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。

五、第十一节"基金的投资"和"第十二节"基金的业绩"部分,根据2015年第三季度报告,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2015年9月30日。

六、第二十二节"基金托管协议的内容摘要"部分;更新了基金托管人的相关信息。

海富通基金管理有限公司

2015年12月5日

证券代码:002054 证券简称:德美化工 公告编号:2015-101

广东德美精细化工股份有限公司 第五届董事会第十次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

一、董事会会议召开情况

广东德美精细化工股份有限公司(以下简称"公司")第五届董事会第十次会议通知于2015年12月1日以通讯和电子邮件方式发出,会议于2015年12月4日(星期五)以通讯方式召开董事会会议,本次会议为临时董事会会议。本次会议应参与表决董事9人,实际参与表决董事 9 人。

本次会