

# 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

(2020 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。

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、基金合同、基金产品资料概要。

本招募说明书所载内容截止日为 2020 年 3 月 2 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2019 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：杨仓兵

成立时间：2003 年 4 月 18 日

电话：021-38650999

联系人：吴晨莺

注册资本：3 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

**杨仓兵先生**，董事长。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经理，海通证券有限公司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 2019 年 3 月任海通证券股份有限公司资金管理总部总经理。2016 年 10 月起兼任海通证券资产管理有限公司董事。2018 年 5 月至 2019 年 3 月兼任海富通基金管理有限公司监事长。2019 年 3 月至 2019 年 4 月任海富通基金管理有限公司董事。2019 年 4 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。2019年2月起兼任海富通资产管理（香港）有限公司董事长。

**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。

**芮政先先生**，董事，理学学士。历任上海警备区教导大队训练处教员，上海社会科学院人口与发展研究所助理研究员，海通证券有限责任公司监察室专务、二科副科长，海通证券股份有限公司人力资源开发部劳资科科长、干部科科长、总经理助理兼干部科科长，海通证券股份有限公司人力资源部总经理助理。2008年10月起担任海通开元投资有限公司监事。2014年11月起至今任海通证券股份有限公司人力资源部副总经理，2015年11月起兼任海通证券股份有限公司纪委委员，2016年11月起兼任海通创新资本管理有限公司董事。2017年12月起兼任海通证券股份有限公司监事。

**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，法国籍，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。

**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。

**杨文斌 (Philip YOUNG Wen Binn) 先生**，独立董事，管理学硕士 (MBA)。历任美国大陆银行（芝加哥，台北）放贷经理，中华开发金控（台湾）资本市场

经理，国际投资信托（台湾）执行副总经理，美银信托（香港）副总经理，日本野村资产管理（香港）投资总监，安泰人寿大中华地区投资总监，日本万通人寿投资总监及常务董事，中国平安保险集团资产管理公司投资总监。2006年7月至2009年4月任中国太平洋人寿保险股份有限公司与中国太平洋（集团）股份有限公司投资总监。2009年4月至2012年11月任太平洋资产管理有限公司投资总监。

**刘正东先生**，独立董事，法律硕士。历任上海市人民检察院铁路运输分院助理检察员，上海市虹桥律师事务所律师。1998年11月至2018年6月任上海市君悦律师事务所主任、高级合伙人。2018年6月起至今任上海市君悦律师事务所首席合伙人、合伙人会议主席。

**陈静女士**，独立董事，硕士。历任中国海洋石油总公司财务部干部，中外运-敦豪有限公司财务部经理，华盛顿普华会计师事务所（现普华永道）审计师，世界银行集团华盛顿总部高级会计官员、高级金融官员，中国证监会规划委高级顾问委员兼会计部副主任，中国投资有限责任公司财务部副总监、董事总经理。2014年5月起至今任瑞士合众集团中国董事会成员。

**曹志刚先生**，监事长，经济学硕士。历任海通证券股份有限公司风险控制总部（稽核部）二级部经理、稽核部总经理助理，自2018年3月至今任稽核部副总经理。2016年11月起至今任海通吉禾股权投资基金管理有限责任公司和海通创意资本管理有限公司监事。

**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。

**胡正万先生**，监事，硕士。先后就职于成都机车车辆厂、四川省证券股份有限公司、富国基金管理有限公司。2003年4月加入海富通基金管理有限公司，历任基金会计、高级注册登记专员、注册登记负责人、基金运营副总监。2015

年7月起任海富通基金管理有限公司基金运营总监。

**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的基金经理助理。

本基金历任基金经理为刘璎女士，任职时间为2011年4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。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：陈四清

注册资本：人民币 35,640,625.7089 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、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：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](http://www.htsec.com)

##### 2) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：王春峰

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

客户服务电话：4006515988

联系人：王星

网址：[www.ewww.com.cn](http://www.ewww.com.cn)

**3) 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

联系人：郭静

网址：[www.cfzq.com](http://www.cfzq.com)

**4) 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：曹宏

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](http://www.cgws.com)

**5) 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：李新华

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](http://www.95579.com)

**6) 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

**7) 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

**8) 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：朱雅葳

网址：www.gtja.com

**9) 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

**10) 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](http://www.gyzq.com.cn)

11) 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](http://www.hongtastock.com)

12) 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](http://www.swhysc.com)

13) 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：哈尔滨市松北区创新三路 833 号

客服电话：4006662288

联系人：姜志伟

网址：[www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn)

14) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：刘世安

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 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](http://stock.pingan.com)

**15) 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](http://www.zts.com.cn)

**16) 兴业证券股份有限公司**

注册地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：杨华辉

办公地址：福建省福州市湖东路 268 号证券大厦 17 楼

客户服务电话：95562

联系人：谢高得

网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

**17) 招商证券股份有限公司**

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 111 号招商证券大厦 23 楼

客户服务电话：95565

联系人：黄婵君

网址：[www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

**18) 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](http://www.chinastock.com.cn)

**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) 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

**21) 中航证券有限公司**

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

法定代表人：王晓峰

办公地址：北京市朝阳区望京东园四区 2 号楼中航资本大厦

客户服务电话：95335

联系人：王紫雯

网址：www.avicsec.com

**22) 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

**23) 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

**24) 中国民族证券有限责任公司**

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

法定代表人：姜志军

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 40-43 层

客户服务电话：4008895618

联系人：程博怡

网址：www.e5618.com

**25) 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

**26) 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

**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) 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：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：薛竞、沈兆杰  
电话：(021) 23238888  
传真：(021) 23238800  
联系人：沈兆杰

## 四、基金的名称

本基金名称：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：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份股临时调整、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，风险管理部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、以及成份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 2019 年 5 月 21 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 2019 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	24,482,029.91	96.94
	其中：股票	24,482,029.91	96.94
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	771,166.43	3.05
7	其他资产	487.10	0.00
8	合计	25,253,683.44	100.00

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,291,336.40	65.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,993,536.11	7.98
E	建筑业	2,785,569.57	11.15
F	批发和零售业	764,871.48	3.06
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	1,874,760.11	7.50
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	601,439.24	2.41
M	科学研究和技术服务业	65,674.00	0.26
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	104,843.00	0.42
S	综合	-	-
	合计	24,482,029.91	97.97

## 2.2 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。

## 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	3,675	3,138,413.25	12.56
2	600276	恒瑞医药	20,441	1,337,250.22	5.35
3	600887	伊利股份	44,206	1,286,836.66	5.15
4	601668	中国建筑	149,485	914,848.20	3.66
5	600900	长江电力	50,390	850,079.30	3.40
6	600104	上汽集团	26,791	698,441.37	2.80
7	601766	中国中车	68,559	623,886.90	2.50
8	600309	万华化学	12,458	567,212.74	2.27
9	600690	青岛海尔	28,948	495,300.28	1.98
10	601888	中国国旅	7,000	490,560.00	1.96

## 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出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	333.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	153.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	487.10

#### 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

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2019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。

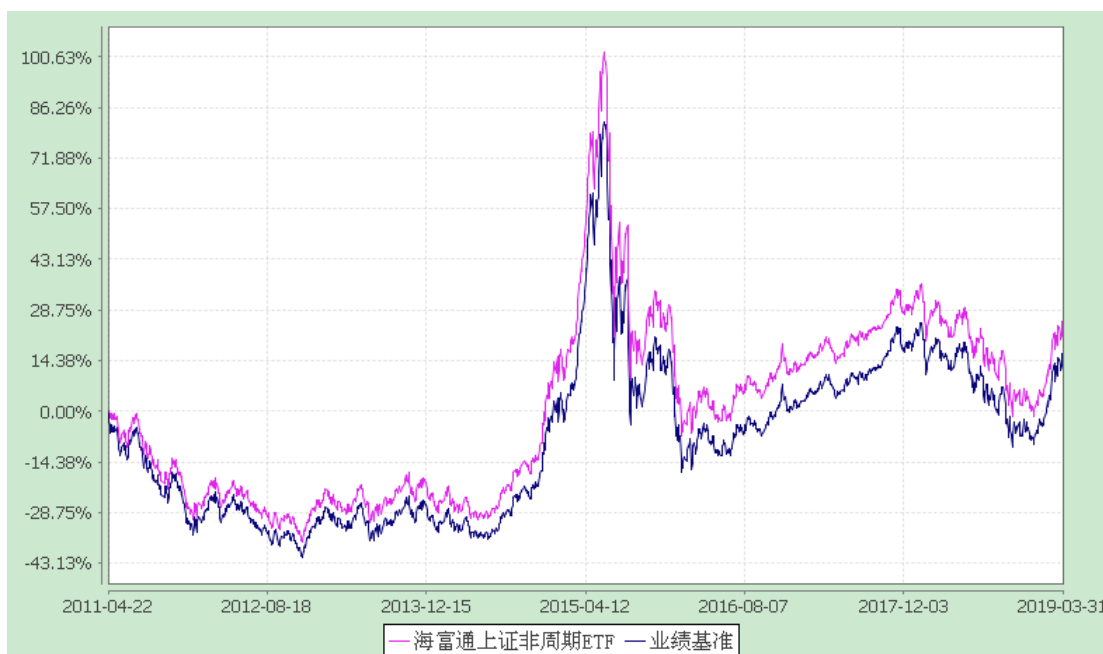
#### (一) 本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

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%
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12月31日	16.06%	2.67%	15.00%	2.78%	1.06%	-0.11%

2016年1月1日至2016年12月31日	-11.56%	1.52%	-11.07%	1.58%	-0.49%	-0.06%
2017年1月1日至2017年12月31日	16.14%	0.62%	17.65%	0.65%	-1.51%	-0.03%
2018年1月1日至2018年12月31日	-21.86%	1.31%	-21.74%	1.35%	-0.12%	-0.04%
2011年4月22日（基金合同生效日）-2019年3月31日	25.41%	1.48%	16.53%	1.54%	8.88%	-0.06%

(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2019年3月31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：

$$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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：

$H = E \times \text{标的指数许可使用费年费率} \div \text{当年天数}$ ，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，当本基金的季度日均基金资产净值(季度日均基金资产净值=基金当季存续日的基金资产净值之和/基金当季存续天数)大于人民币 5000 万元时，许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 35,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算；当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时，无许可使用费的收取下限。许可使用基点费的支付方式为每季度支付一次。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。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

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 日在指定媒介公告。

#### **(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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同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。本次重大更新事项为调整了标的指数许可使用费的相关规定。主要更新的内容如下:

一、“第四节 基金托管人”部分,更新了相关信息。

二、“第五节 相关服务机构”部分,更新了会计师事务所的相关信息。

三、“第十六节 基金的费用和税收”部分,更新了标的指数许可使用费的相关信息。

海富通基金管理有限公司

2020年3月4日