

# 上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

(2013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

上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金(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]885号核准募集。本基金的基金合同于2010年9月10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制,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,所获资金或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,对投资本基金的投资、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持份额享受基金的收益,但同时也能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、标的指数波动风险以及基金投资组合回报与标的指数跟踪偏离的风险、基金净值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2013年3月19日,有关财务数据和净值表现截止日为2012年12月31日。

## 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:邵国华  
成立时间:2003年4月18日  
电话:021-38680999  
联系人:包理  
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B控股公司49%。  
(二)主要人员情况  
邵国华先生,董事长,副教授,历任吉林大学党委副书记,长春师范学院党委书记,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主任、交通银行北京分行证券部经理,海通证券北京国际同业部总经理等职。1997年至今任海通证券股份有限公司副总裁。2011年4月至今任海通国际证券集团有限公司董事会主席。  
艾德加 Stewart Edgar先生,董事,英国籍,学士。历任英国Vory & Sims公共有限公司总经理、美国Fiduciary国际信托公司研究部主任、高级副总裁,美国HDF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,英国海富通基金管理有限公司董事总经理,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Eunopiecent S.A.公司总裁助理,富通银行区域经理,大中华地区主管,富通基金欧洲亚洲有限公司投资经理、业务发展总监等职,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学副教授、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席教授。  
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,EFAMA 欧洲基金和管理协会(La Fédération des Associations de Banquiers, INVESTPROTECT.COM 布鲁塞尔)董事总经理, Pomeroy集团公司公关总监, P&S 独立副董事长, Fundoconnect 独立董事长, Degroff 资产管理布鲁塞尔)独立董事和法国巴黎银行 Flexi BEAMICA 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委副书记,上海出租汽车公司党委书记,股份人众交集团(集团)股份有限公司董事长兼总经理,上海市大众公用事业(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(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,人大财经委员会委员。  
李勇前先生,董事长,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。

谷岩嵩 Laurent Couraudon先生,监事,法国籍,斯特拉斯堡的罗伯特特曼大学的国际工商管理硕士学位。历任法国外贸银行莫斯科分行董事及企业融资主管,法国巴黎银行俄罗斯分行商务拓展主管及法国巴黎银行莫斯科分行首席执行官兼俄罗斯地区总裁等职。2011年至今任法国巴黎银行(中国)有限公司董事兼中国区总裁。  
莫乃荣先生,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稽核稽核部稽核员。2003年4月至今任海富通基金管理有限公司稽核稽核部、监察稽核总监。  
高勇前先生,监事,经济学学士。历任宁波进出口公司财务部会计主管,上海科源医药高科技实业公司财务部财务主管,华安基金管理有限公司财务部财务部副总监。2008年4月至今任海富通基金管理有限公司基金运营总监。  
章明女士,督察长,硕士。历任加拿大BICC Tech & Trade Int'l Inc.公司高级财务经理,加拿大Future Electronics.公司产品专家,信息技术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,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,富通基金管理有限公司基金经理。2003年4月至今任海富通精选混合基金经理,2003年4月至2012年9月任海富通基金管理有限公司投资总监,2005年7月至2006年9月任海富通股票基金经理,2006年11月至9月任海富通收益增长基金经理,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4月任海富通风格优势股票基金经理,2007年4月至2008年8月任海富通精选2号混合基金经理,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,富通基金管理有限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。  
陶海刚先生,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。2006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。

刘璐女士,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月起兼任海富通中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。

本基金历任基金经理为蒋苑生,任职时间为2010年9月至2012年1月。

投资决策委员会常设委员有:田仁灿,总经理;陈洪,副总经理;戴德舜,投资总监;蒋苑,投资副总监;邵国华,投资副总监;丁俊,研究总监;杜晓海,定量风险管理总监。投资决策委员会主任主席由副总经理担任。讨论内容涉及特定基金时,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349,018,545,827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  
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:021-95533或4008888001  
联系人:李奕鸣  
网址:www.htsec.com

2)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

3)光大证券股份有限公司  
地址:上海市静安区新闻路1508号  
法定代表人:徐浩明  
客户服务电话:95525  
联系人:吴晨、李芳芳  
网址:www.ebscn.com

4)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  
网址:www.cfzq.com

5)齐鲁证券有限公司  
地址:山东省济南市经一路86号  
法定代表人:李玮  
客户服务电话:95538  
联系人:孙宏志  
网址:www.qlzq.com.cn

6)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:蔡咏  
客户服务电话:95578  
联系人:陈琳琳  
网址:www.gyzq.com.cn

7)长城证券有限责任公司  
注册地址: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:黄伟华  
客户服务电话:4006668888  
联系人:高峰  
网址:www.cgws.com

8)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转8  
联系人:薛宇婧  
网址:stock.pingan.com

9)广州证券股份有限公司  
地址:广州市越秀区先烈中路69号东山广场主楼17楼  
法定代表人:刘东  
客户服务电话:020-961303  
联系人:林洁茹  
网址:www.gzsq.com.cn

10)东吴证券股份有限公司  
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  
客户服务电话:4008-888-993  
联系人:黄真  
网址:www.dwzq.net

11)德邦证券有限责任公司  
住所:上海市福州路500号城建国际中心26层  
法定代表人:姚文平  
客户服务电话:4008888128  
联系人:李晔  
网址:www.tebon.com.cn

12)东方证券股份有限公司  
地址:上海市中山东路318号2号楼21层-29层  
法定代表人:潘鑫军  
客户服务电话:95503  
联系人:吴月  
网址:www.dfq.com.cn

13)上海证券有限责任公司  
地址:上海市黄浦区西藏中路336号  
法定代表人:郁忠民  
客户服务电话:4008918918、021-962518  
联系人:陈翔  
网址:www.962518.com

14)江海证券有限公司  
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号  
法定代表人:孙洪涛  
联系人:高悦洁  
客户服务电话:400-666-2288  
公司网站:www.jhq.com.cn

15)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

16)山西证券股份有限公司  
地址:山西省太原市西南街69号山西国际贸易中心东塔楼  
法定代表人:侯键  
客户服务电话:400-666-1618  
联系人:张治国  
网址:www.sx618.com.cn

17)红塔证券股份有限公司  
地址:云南省昆明市北京路155号附一红塔大厦9楼  
法定代表人:况雨林  
客户服务电话:0871-357942  
联系人:刘晓明  
网址:www.hongtastock.com

18)广发证券股份有限公司  
法定代表人:孙明  
注册地址:广州天河区河北路181-187号大都会广场43楼 4301-4316房  
办公地址:广东省广州天河区北路大都会广场5.18.19.36.38.39.41.42.43.44楼  
联系人:黄真  
统一客户服务热线:95575或致电各地营业部网点  
公司网站:www.gf.com.cn

19)中信证券股份有限公司  
地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦  
法定代表人:王东明  
电话:95558  
联系人:顾凌  
网址:www.cscitic.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代理销售本基金,并及时公告。

2.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:金颖  
电话:010-59378835  
传真:010-59378907  
联系人:刘永卫

3.出具法律意见书的律师事务所  
名称:上海锦天城律师事务所  
地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼  
负责人:韩朝  
电话:021-31358666  
传真:021-3135 8600  
联系人:黎明  
联系电话:021-31358666-8663

4.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:汪林、王灵  
电话:021) 23238888  
传真:021) 23238800  
联系人:刘莉

客户服务热线:0871-357942

联系人:刘晓明

网址:www.hongtastock.com

18)广发证券股份有限公司

法定代表人:孙明

注册地址:广州天河区河北路181-187号大都会广场43楼 4301-4316房

办公地址:广东省广州天河区北路大都会广场5.18.19.36.38.39.41.42.43.44楼

联系人:黄真

统一客户服务热线:95575或致电各地营业部网点

公司网站:www.gf.com.cn

19)中信证券股份有限公司

地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人:王东明

电话:95558

联系人:顾凌

网址:www.cscitic.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代理销售

本基金,并及时公告。

2.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:金颖

电话:010-59378835

传真:010-59378907

联系人:刘永卫

3.出具法律意见书的律师事务所

名称:上海锦天城律师事务所

地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:韩朝

电话:021-31358666

传真:021-3135 8600

联系人:黎明

联系电话:021-31358666-8663

4.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:汪林、王灵

电话:021) 23238888

传真:021) 23238800

联系人:刘莉

## 四、基金的名称

本基金名称:上证周期行业50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 and 范围

本基金主要投资于标的指数的成份股、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。在建仓完成后,本基金投资标的指数的成份股、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及基金合同的规定执行。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,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。

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,基金管理人可以对投资组合进行适当调整和,以实现跟踪标的指数的有效控制,法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,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结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,防范重大风险的发生。

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制的指数成份股及成份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,基金经理采取适当的方法,降低买入成本,跟踪投资风险。  
4)交易执行:交易员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。绩效评估能够验证组合是否实现了投资预期,组合误差的来源及投资决策成功与否,基金经理可以据此优化投资组合,进而调整投资组合。  
6)组合维护:基金经理跟踪标的指数变动,结合成份股基本情况、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情况需要对上述投资管理程序和程序做出调整,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,本基金按照合理方法选择替代股票。  
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.日常投资管理

1)标的指数的成份股跟踪  
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,基金管理人将根据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,寻找将实际投资组合调整到目标组合的最佳方案,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,对股票投资组合及时进行调整。  
2)定期对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、基金托管费等支付要求,及时检查组合中现金的流动性,进行定期支付现金的准备。

## 7.投资绩效评价

1)每日对基金的投资绩效进行评估,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跟踪偏离度和跟踪误差产生原因,对股票投资组合进行调整,并制定跟踪误差管理方案。

4)定期对本基金与标的指数的跟踪误差进行分析,确定跟踪误差来源,优化指数跟踪方案。  
5)根据基金合同中基金管理费、基金托管费等支付要求,及时检查组合中现金的流动性,进行定期支付现金的准备。

## 8.建立建仓策略

本基金主要投资于标的指数的成份股、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。在建仓完成后,本基金投资标的指数的成份股、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及基金合同的规定执行。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

9.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周期行业50指数。  
如果指数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指数不再继续作为标的指数,或因市场有其他替代变更更合适投资的指数推出时,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,变更本基金业绩比较基准的指数。

10.基金的风险收益特征  
本基金属股票型基金,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,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

11.基金的投资组合报告  
基金管理人的董事会及基金管理人保证本报告不存在虚假记载、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。本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2013年4月15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12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	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	291,832,126.50	97.92
2	固定收益投资	291,832,126.50	97.92
3	银行存款	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其他金融资产	-	-
6	合计	298,028,793.06	100.00

注:报告期末的公允价值包含可退替代款的公允价值。  
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	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	采矿业	46,565,295.80	15.70
C	制造业	20,793,006.46	7.01
CD	食品饮料	-	-
CJ	纺织服饰、轻工	-	-
C2	木材造纸	3,020,067.17	1.04
C3	医药、生物制药	-	-
C4	电子、化学、橡胶、塑料	-	-
CS	石油、石化、能源、金属	-	-
CO	金属、非金属	20,793,006.46	7.01
C7	电信业务、仪表	-	-
C8	医药、生物制药	-	-
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气、热力生产和供应业	-	-
E	交通运输、仓储业	6,863,714.40	2.31
F	信息技术业	-	-
G	房地产业	16,340,607.68	5.51
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
合计		291,832,126.50	98.39

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	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	1,918,143	26,374,466.23	8.89
2	600030	中信证券	1,789,289	23,904,901.04	8.06
3	600016	兴业银行	3,020,067	23,727,883.82	8.00
4	601318	中国平安			