

# 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

(2019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】985号文核准募集。本基金的基金合同于2010年9月19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本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。基金投资人了解其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,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策。

本招募说明书所载内容截止日为2019年3月19日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年12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BSC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划财科副科长,安徽立康药业有限公司财务总监,海通证券股份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,上海海康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产管理部副总经理。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,华宝信托投资有限公司研究发展中心主任兼股权投资管理部总经理,华宝信托投资有限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股份有限公司董事长。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理股份有限公司董事长。2019年1月起兼任海富通资产管理有限公司董事长。

吴淑敏先生,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。

芮政良先生,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 (陶尔斯)女士,董事,法国与墨西哥双国籍,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月任法国巴黎银行资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 Wemom(沃姆)先生,董事,法国籍,金融硕士学历。2007年9月至2013年4月在法国兴业投资银行全球市场部担任执行董事、中国区开发负责人职务;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。

张敬先生,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)信贷经理,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,日本万寿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股份有限公司投资总监。

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,外经贸-敦豪有限公司财务部经理,华盛诺普华会计师事务所(现普华永道)审计师,世界银行集团华盛诺总部高级会计专员、高级金融官员,中国证监会规划委换届顾问委员会会计部副主任,中国投资有限责任公司财务部副总监、董事总经理。2014年6月至今任瑞士集团大拿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、稽核部投资经理助理,自2018年3月至今任稽核部投资经理。2016年11月起至今任海通吉禾股权投资基金管理有限公司和嘉诚创富资产管理咨询有限公司监事。

Bruno Weil (魏尚诺)先生,监事,法国籍,博士。历任巴黎银行东亚负责人、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。

俞海先生,监事,博士,CPA。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,历任产品及创新总监。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。

奚乃荣先生,督察长,经济学硕士,中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省银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咨询有限公司监事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理咨询有限公司董事。

陶网德先生,副总经理,硕士。历任中国电子器材华东公司会计科长,上海中实业发展有限公司主管会计,海通证券股份有限公司财务部副经理。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咨询有限公司董事。

何树芳先生,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),魁北克公共退休基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)、海富通中证内地低波动指数的基金经理。

纪莉凯先生,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投资研究、期权交易助理。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蒋征先生,任职时间为2010年9月至2012年1月;刘霞女士,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、多资产策略投资部总监;王宗叶,研究部总监;陈殊平、固定收益投资部副总监;赵越,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。

## 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35,640,625.71万元  
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. 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:李美琦  
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  
3) 光大证券股份有限公司  
注册地址:上海市静安区新闻路1508号  
法定代表人:周健明  
办公地址:上海市静安区新闻路1508号  
客户服务电话:95525  
联系人:姚媛  
网址:www.ebscn.com  
4) 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  
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  
5) 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  
6) 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4008887777  
联系人:李秦  
网址:www.gyzq.com.cn  
7) 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  
8) 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:周皓  
网址:stock.pingan.com  
9) 广州证券股份有限公司  
注册地址:广州市天河区珠江江西路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:95536  
联系人:林洁茹  
网址:www.gzsc.com.cn  
10) 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:95509  
联系人:汤漫川  
网址:www.dxzq.net  
11) 德邦证券股份有限公司  
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢楼  
法定代表人:武晓春  
办公地址:上海市蒲汇山路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  
12) 东方证券股份有限公司  
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层  
法定代表人:潘鑫军  
办公地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层  
客户服务电话:95503  
联系人:胡月娟  
网址:www.dfzq.com.cn  
13) 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:4006918918  
联系人:邵珍珍  
网址:www.shzq.com  
14) 江海证券有限公司  
注册地址:哈尔滨市香坊区赣水路66号  
法定代表人:赵斌波  
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  
15) 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: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  
16) 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.j618.com.cn  
17) 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:李荣明  
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  
18) 广发证券股份有限公司  
注册地址:广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室  
法定代表人:孙树明  
办公地址:广州市天河区马场路26号广发证券大厦  
客户服务电话:95575或致电各地营业网点  
联系人:黄岚、马梦洁  
网址:www.gf.com.cn  
19) 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.csc108.com  
20) 西藏东方财富证券股份有限公司  
注册地址:西藏自治区北京市中路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

21) 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:许梦圆  
网址:www.csc108.com

22) 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:辛国欣  
网址:www.chinastock.com.cn

23) 中泰证券股份有限公司  
注册地址:济南市经七路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

24) 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4008887777  
联系人:李秦  
网址:www.gyzq.com.cn

25) 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

26) 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:周皓  
网址:stock.pingan.com

27) 广州证券股份有限公司  
注册地址:广州市天河区珠江江西路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:95536  
联系人:林洁茹  
网址:www.gzsc.com.cn

28) 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:95509  
联系人:汤漫川  
网址:www.dxzq.net

29) 德邦证券股份有限公司  
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢楼  
法定代表人:武晓春  
办公地址:上海市蒲汇山路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

30) 东方证券股份有限公司  
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层  
法定代表人:潘鑫军  
办公地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层  
客户服务电话:95503  
联系人:胡月娟  
网址:www.dfzq.com.cn

31) 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:4006918918  
联系人:邵珍珍  
网址:www.shzq.com

32) 江海证券有限公司  
注册地址:哈尔滨市香坊区赣水路66号  
法定代表人:赵斌波  
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

33) 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: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

34) 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.j618.com.cn

35) 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:李荣明  
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

36) 广发证券股份有限公司  
注册地址:广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室  
法定代表人:孙树明  
办公地址:广州市天河区马场路26号广发证券大厦  
客户服务电话:95575或致电各地营业网点  
联系人:黄岚、马梦洁  
网址:www.gf.com.cn

37) 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.csc108.com

38) 西藏东方财富证券股份有限公司  
注册地址:西藏自治区北京市中路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

39) 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:许梦圆  
网址:www.csc108.com

40) 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:辛国欣  
网址:www.chinastock.com.cn

41) 中泰证券股份有限公司  
注册地址:济南市经七路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

42) 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4008887777  
联系人:李秦  
网址:www.gyzq.com.cn

43) 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

44) 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:周皓  
网址:stock.pingan.com

45) 广州证券股份有限公司  
注册地址:广州市天河区珠江江西路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:95536  
联系人:林洁茹  
网址:www.gzsc.com.cn

46) 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:95509  
联系人:汤漫川  
网址:www.dxzq.net

47) 德邦证券股份有限公司  
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢楼  
法定代表人:武晓春  
办公地址:上海市蒲汇山路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

48) 东方证券股份有限公司  
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层  
法定代表人:潘鑫军  
办公地址:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层  
客户服务电话:95503  
联系人:胡月娟  
网址:www.dfzq.com.cn

49) 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:4006918918  
联系人:邵珍珍  
网址:www.shzq.com

50) 江海证券有限公司  
注册地址:哈尔滨市香坊区赣水路66号  
法定代表人:赵斌波  
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

51) 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: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

52) 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.j618.com.cn

53) 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:李荣明  
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

54) 广发证券股份有限公司  
注册地址:广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室  
法定代表人:孙树明  
办公地址:广州市天河区马场路26号广发证券大厦  
客户服务电话:95575或致电各地营业网点  
联系人:黄岚、马梦洁  
网址:www.gf.com.cn

## 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,基金经理可以对该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该品种的其他品种,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,定期或遇重大事件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,进行基金投资管理中的日常决策。

(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查投资策略,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状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,密切跟踪标的指数的成份股。

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需要对上述投资管理制度和程序做出调整,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  
如果出现标的指数的成份股临时调整、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至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布。

## 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) 本基金基金投资组合将根据标的指数的编制规则,各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,优化指数跟踪策略。

(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比例,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情况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%,年跟踪误差率不超过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、基金的投资业绩比较基准

本基金业绩比较基准为标的指数。本基金跟踪的指数为上证周期行业50指数。如果指数编制方法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,或由指数编制方法等发生重大变更导致上证周期行业50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。

## 十、基金的风险收益特征