

## 信息披露 disclosure

## 上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金

## 【2014】半年度报告摘要

的基金的估值政策和程序。

估值委员会下设估值工作小组。估值工作小组充分听取相关部门的意见,并和相关托管人充分协商后,向估值委员会提交估值建议和估值政策和程序评估报告,由估值委员会决策。

估值委员会估值委员会审阅同意,并经本公司总裁办公会批准后实施。

本基金按照报批后的估值政策和程序进行估值。

除了投资违约外,其他基金经理不是估值委员会和估值工作小组的成员,不参与估值政策的决策。但是对于涉及投资品种,基金经理应向估值工作小组提供投资建议。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

对于在交易所上市证券,采用交易所发布行情信息来定价;对于固定收益品种,采用证券估值委员会估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准。

4.7 管理人应对报告期内基金利润分配情况的说明  
根据基金合同的规定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过同期加权报酬率达到1%以上,基金管理人可进行收益分配。

本基金报告期内未进行利润分配,但符合基金合同约定。

5.1 报告期内本基金托管人遵守情况声明  
2014年上半年,本基金托管人在对上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 管理人应对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明  
2014年上半年,上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金的投资管理—海富通基金管理有限公司在上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金的投资运作,基金资产净值计算、基金申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要环节均严格按照基金合同的约定进行。本报告期内,上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 管理人对本半年度报告中财务信息内容的真实性、准确性和完整性发表意见  
本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制的上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金2014年半年度报告中财务信息、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

6.1 资产负债表  
会计主体:上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金  
报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	本报告期 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:		
银行存款	4,305,328.74	6,000,465.76
结算备付金	61.20	3,835.83
存出保证金	3,548.71	5,967.25
交易性金融资产	151,462,086.87	191,254,726.22
买入返售金融资产	151,462,086.87	191,254,726.22
应收利息	675.06	1,204.50
应收股利	—	—
应收证券清算款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	0.01	0.01
资产总计	155,771,700.59	197,270,707.46
负债和所有者权益		
负债:		
短期借款	—	—
应付利息	—	—
应付股利	—	—
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	63,985.10	85,670.24
应付托管费	12,796.99	17,134.04
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	—	—
其他负债	8,425.24	22,649.47
所有者权益	—	—
实收基金	200,386,779.14	242,249,914.61
未分配利润	-44,958,557.05	-45,526,570.90
所有者权益合计	155,428,222.09	196,723,343.71
负债和所有者权益总计	155,771,700.59	197,270,707.46

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.933元,基金份额总额80,416,764.00份。

6.2 利润表  
会计主体:上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金  
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

资产	本报告期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	-8,513,083.46	-40,090,127.98
1.利息收入	17,894.75	10,008.02
其中:存款利息收入	17,894.75	10,008.02
债券利息收入	—	—
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	-5,733,147.46	9,325,747.76
其中:股票投资收益	-7,322,002.44	5,195,483.24
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
公允价值变动收益(损失以“-”填列)	1,588,854.98	4,130,264.52
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	-2,798,295.03	-49,426,455.03
4.其他收入(损失以“-”填列)	64.30	57.17
减:二、费用	828,111.16	1,151,359.46
1.管理费用	420,178.11	687,281.16
2.销售费用	84,746.27	133,476.63
3.销售服务费	—	—
4.利息支出	14,704.14	41,915.60
5.其他费用	—	—
其中:卖出回购金融资产支出	—	—
6.其他费用	308,527.37	308,527.37
三、利润总额(亏损总额以“-”填列)	-9,341,194.64	-41,241,487.44
四、净利润(净亏损以“-”填列)	-9,341,194.64	-41,241,487.44

6.3 所有者权益(基金净值)变动表  
会计主体:上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金  
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	242,249,914.61	-45,526,570.90	196,723,343.71
二、本期利润分配产生的基金份额净变动(本期利润)	—	-9,341,194.64	-9,341,194.64
三、本期基金份额变动产生的基金份额净变动(本期申购和赎回等导致)	-41,863,135.47	9,909,208.49	-31,953,926.98
四、本期基金份额持有人认购/申购/赎回/转换及转入/转出产生的基金份额净变动(扣除申购/赎回/转换费用)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	200,386,779.14	-44,958,557.05	155,428,222.09

注:报告期内本基金管理人未发生任何关联交易。

6.4 投资组合报告  
6.4.1 基金资产组合情况  
单位:人民币元

资产	本报告期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
一、权益投资	151,462,086.87	97,223
其中:股票	151,462,086.87	97,223
二、固定收益投资	—	—
其中:债券	—	—
资产支持证券	—	—
三、贵金属投资	—	—
四、金融衍生品投资	—	—
五、买入返售金融资产	—	—
其中:买入返售金融资产	—	—
六、银行存款和结算备付金合计	4,305,328.74	2,76
七、其他资产	—	—
合计	155,771,700.59	100.00

注:投资组合报告期末本基金投资组合的行业分布情况如下表所示。

代码	行业名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	14,720,801.89	9.47
C	制造业	8,791,427.76	5.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发性贸易	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	4,562,002.47	2.94
H	住宿和餐饮业	—	—
I	金融业、软件和信息技术服务业	—	—
J	房地产业	116,202,102.18	74.76
K	综合业	7,185,552.57	4.62
L	研究和实验发展业	—	—
M	教育和文化艺术业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	24,720.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	房地产业	—	—
Q	卫生健康业	—	—
R	农、林、牧、渔业	—	—
S	其他	—	—
合计	151,462,086.87	97.45	

7.3 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  
单位:人民币元

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	600318	中信证券	373,571	14,496,283.14	9.46
2	600016	民生银行	2,092,904	12,929,033.84	8.36
3	600128	农业银行	1,259,236	12,894,266.43	8.30
4	600030	中信证券	1,113,789	12,764,021.94	8.27
5	600018	光大银行	893,547	8,962,276.31	5.71
6	600000	浦发银行	876,642	7,933,791.30	5.10
7	601999	招商银行	1,590,534	6,231,105.42	4.07
8	601328	交通银行	1,539,448	6,206,634.24	3.99
9	601288	农业银行	2,043,847	5,102,414.44	3.28
10	601011	中国大学	24,872	4,418,537.80	2.84

注:投资组合报告期末本基金投资组合的所有股票明细,应阅读登载于www.hffund.com网站的半年度报告全文。

7.1 报告期内股票投资组合的重大变动  
7.1.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细  
单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	买入金额	占基金资产净值比例(%)
1	600019	浦发银行	1,190,383.58	0.61
2	600030	中信证券	1,078,671.00	0.55
3	600016	民生银行	1,292,904	0.65
4	600030	中信证券	1,113,789	0.57
5	600000	浦发银行	876,642	0.44
6	601999	招商银行	1,590,534	0.81
7	601328	交通银行	1,539,448	0.78
8	601328	交通银行	1,539,448	0.78
9	601011	中国大学	24,872	0.01
10	601011	中国大学	24,872	0.01

注:投资组合报告期末本基金投资组合的所有股票明细,应阅读登载于www.hffund.com网站的半年度报告全文。

7.1.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细  
单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	卖出金额	占基金资产净值比例(%)
1	600019	浦发银行	762,320.00	0.39
2	601818	光大银行	627,200.00	0.32
3	600016	民生银行	1,292,904	0.65
4	600030	中信证券	1,113,789	0.57
5	600000	浦发银行	876,642	0.44
6	601999	招商银行	1,590,534	0.81
7	601328	交通银行	1,539,448	0.78
8	601328	交通银行	1,539,448	0.78
9	601011	中国大学	24,872	0.01
10	601011	中国大学	24,872	0.01

注:投资组合报告期末本基金投资组合的所有股票明细,应阅读登载于www.hffund.com网站的半年度报告全文。

7.1.3 买入金额前10名中,沪港通标的股票明细  
单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	买入金额	占基金资产净值比例(%)
1	600019	浦发银行	1,190,383.58	0.61
2	600030	中信证券	1,078,671.00	0.55
3	600016	民生银行	1,292,904	0.65
4	600030	中信证券	1,113,789	0.57
5	600018	光大银行	893,547	0.46
6	600000	浦发银行	876,642	0.44
7	601999	招商银行	1,590,534	0.81
8	601328	交通银行	1,539,448	0.78
9	601288	农业银行	2,043,847	1.05
10	601011	中国大学	24,872	0.01

注:投资组合报告期末本基金投资组合的所有股票明细,应阅读登载于www.hffund.com网站的半年度报告全文。

7.1.4 卖出金额前10名中,沪港通标的股票明细  
单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	卖出金额	占基金资产净值比例(%)
1	600019	浦发银行	762,320.00	0.39
2	601818	光大银行	627,200.00	0.32
3	600016	民生银行	1,292,904	0.65
4	600030	中信证券	1,113,789	0.57
5	600000	浦发银行	876,642	0.44
6	601999	招商银行	1,590,534	0.81
7	601328	交通银行	1,539,448	0.78
8	601328	交通银行	1,539,448	0.78
9	601011	中国大学	24,872	0.01
10	601011	中国大学	24,872	0.01

注:投资组合报告期末本基金投资组合的所有股票明细,应阅读登载于www.hffund.com网站的半年度报告全文。

7.1.5 买入金额前10名中,沪港通标的股票明细  
单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	买入金额	占基金资产净值比例(%)
1	600019	浦发银行	1,190,383.58	0.61
2	600030	中信证券	1,078,671.00	0.55
3	600016	民生银行	1,292,904	0.65
4	600030	中信证券	1,113,789	0.57
5	600018	光大银行	893,547	0.46
6	600000	浦发银行	876,642	0.44
7	601999	招商银行	1,590,534	0.81
8	601328	交通银行	1,539,448	0.78
9	601288	农业银行	2,043,847	1.05
10	601011	中国大学	24,872	0.01

注:投资组合报告期末本基金投资组合的所有股票明细,应阅读登载于www.hffund.com网站的半年度报告全文。

7.1.6 卖出金额前10名中,沪港通标的股票明细  
单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	卖出金额	占基金资产净值比例(%)
1	600019	浦发银行	762,320.00	0.39
2	601818	光大银行	627,200.00	0.32
3	600016	民生银行	1,292,904	0.65
4	600030	中信证券	1,113,789	0.57
5	600000	浦发银行	876,642	0.44
6	601999	招商银行	1,590,534	0.81
7	601328	交通银行	1,539,448	0.78
8	601328	交通银行	1,539,448	0.78
9	601011	中国大学	24,872	0.01
10	601011	中国大学	24,872	0.01

注:投资组合报告期末本基金投资组合的所有股票明细,应阅读登载于www.hffund.com网站的半年度报告全文。

7.1.7 买入金额前10名中,沪港通标的股票明细  
单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	买入金额	占基金资产净值比例(%)
1	600019	浦发银行	1,190,383.58	0.61
2	600030	中信证券	1,078,671.00	0.55
3	600016	民生银行	1,292,904	0.65
4	600030	中信证券		