海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金

【2015】第二季度报告

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
报告送出日期:二〇一五年七月十八日

§1 重要提示

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7月17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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1基金基本情况

基金简称	海富通上证非周期ETF联接
基金主代码	519032
交易代码	519032
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月27日
报告期末基金份额总额	41,180,797.47份
投资目标	通过投资于上证非周期行业100ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金通过主要投资于上证非周期行业100ETF,标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数的表现。建仓完成后,正常情况下投资于上证非周期行业100ETF的比例不低于基金资产净值的90%。
业绩比较基准	上证非周期行业100指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属股票型基金,预期风险与收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金的联接基金,具有与上证非周期行业100指数相似的风险收益特征。
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

2.1.1目标基金基本情况

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
基金主代码	510120
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年4月22日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2011年6月8日
基金管理人名称	海富通基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

注:本表所列的基金主代码510120为目标基金的二级市场交易代码,目标基金的一级市场申购赎回代码为510121。

2.1.2目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
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或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。
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
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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	25,253,358.10
2.本期利润	10,344,317.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.1551
4.期末基金资产净值	62,447,702.72
5.期末基金份额净值	1.516

注:(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	10.17%	2.62%	13.40%	2.76%	-3.23%	-0.14%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011年4月27日至2015年6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十一部分(二)投资范围、(六)投资限制中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘璎	本基金的基金经理;海富通上证非周期ETF基金经理;海富通上证周期ETF联接基金经理;海富通上证周期ETF基金经理;海富通中证100指数(LOF)基金经理;海富通中证内地低碳指数基金经理;指数投资部指数投资负责人	2011-04-27	-	14年	管理学硕士,持有基金从业人员资格证书。历任海通证券公司固定收益部债券业务助理、债券销售主管、债券分析师、债券投资部经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司,历任固定收益分析师、基金经理、固定收益组合管理部总监、投资副总监,现任总经理助理。2005年1月至2008年2月任海富通货币基金经理,2006年5月起任海富通强化回报混合基金经理,2008年10月至2015年1月任海富通稳添利债券基金经理,2010年11月至2015年1月任海富通稳固收益债券基金经理,2013年1月至2015年1月任海富通稳进增利债券(LOF)基金经理。
郝佳民	本基金的基金经理;总经理助理	2006-05-25	-	18年	硕士,持有基金从业人员资格证书。历任海通证券公司固定收益部债券业务助理、债券销售主管、债券分析师、债券投资部经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司,历任固定收益分析师、基金经理、固定收益组合管理部总监、投资副总监,现任总经理助理。2005年1月至2008年2月任海富通货币基金经理,2006年5月起任海富通强化回报混合基金经理,2008年10月至2015年1月任海富通稳添利债券基金经理,2010年11月至2015年1月任海富通稳固收益债券基金经理,2013年1月至2015年1月任海富通稳进增利债券(LOF)基金经理。
谢志刚	本基金的基金经理;海富通养老收益混合基金经理;海富通领先成长股票和海富通国策导向股票基金经理	2014-01-17	2015-06-11	14年	MBA,硕士,持有基金从业人员资格证书。历任国泰君安证券研究所行业研究员、美国康奈尔资本公司助理投资经理、华宝兴业基金管理有限公司高级研究员、西蒙莫瑞中国基金公司研究总监、信诚基金管理有限公司Eastspring China Dragon A Share Fund(QFII)投资经理(谢基金由信诚基金担任投资顾问),2013年9月加入海富通基金管理有限公司,2013年10月至2015年6月担任海富通养老收益混合基金经理,2014年1月至2015年6月兼任海富通强化回报混合基金经理,2014年4月至2015年6月兼任海富通领先成长股票和海富通国策导向股票基金经理。
张炳伟	本基金的基金经理	2015-06-03	-	6年	硕士,持有基金从业人员资格证书。曾任交银施罗德基金管理有限公司数量分析师,2011年7月加入海富通基金管理有限公司,任股票分析师。2015年6月起任海富通强化回报混合基金经理。

注:1、对基金的首任基金经理,其任职日期指基金合同生效日,离任日期指公司作出决定之日;非首任基金经理,其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准:自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司根据证监会2011年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求,持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时,公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司建立了严格的投资交易行为监控制度,公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部、监察稽核部和风险管理部组成,各部门各司其职,对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控,保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内,公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析,并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)同向交易的样本,对其进行了95%置信区间,假设溢价率为0的T分布检验,检验结果表明,在T日、T+3日和T+5日不同循环期内,不管是买入或是卖出,公司各组合间买卖价差不显著,表明报告期内公司对旗下各基金进行了公平对待,不存在各投资组合之间进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

进入2015年二季度,经济进一步下行,A股市场巨幅震荡,经历了冲高回落的过山车行情。4月初至5月下旬,大盘指数均维持了此前的稳步上行趋势。"5.28"当日,沪指大跌6.5%,随即市场进入震荡期,6月中旬沪指上攻至5000点后,指数旋即大跌,6月底沪指重回4200点附近。

政策面方面,无论财政政策还是货币政策均是暖风不断。多家官方媒体撰文强调经济面临较大压力局势下股市的重要意义;国企改革、一带一路、京津冀、中国制造2025等主题的相关政策不断充实;央行更是频频出手为市场注入流动性,4月20日起央行存款准备金率下调1个百分点,5月8日央行降息0.25个百分点,6月27日央行祭出"定向宽松+降息"的组合拳。

指数方面,各主要市场指数历经震荡,仍然全部收涨。整个二季度,上证综指、深证成指分别上涨14.12%、10.41%;而中小板指和创业板指涨幅则高达15.32%、22.42%。行业方面,就中信证券一级行业指数而言,二季度仅非银行金融收跌,其余行业悉数上涨。其中,国防军工、交通运输、轻工制造、机械等板块涨幅居前,均上涨35%以上。在"国家意志+军民融合"背景下,国防军工行业二季度涨幅超40%,受到投资者的青睐。

作为指数基金,在操作上我们严格遵守基金合同,应用指数复制策略和数量化手段提高组合与指数的拟合度,降低跟踪误差。

4.5报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为10.17%,同期业绩比较基准收益率为13.40%。年跟踪误差为2.17%,日均跟踪偏离度的绝对值为0.0056%,在合同规定的目标控制范围之内。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,政府有望继续延续既有的货币政策和财政政策,宏观经济将触底企稳。至于A股市场,市场参与者的热情随着二季度末的大跌而迅速降温,且对市场资金面拐点到来的担忧迅速上升,从而对市场走势构成制约。基于此,三季度预计将出现宽幅振荡格局。但在牛市格局下,类似振荡有望夯实市场基础,为今后上行创造条件,与此同时结构性机会预计将层出不穷。

未来,本基金将继续严格按照基金合同的要求,秉承指数化投资策略,提高组合与指数的拟合度。

4.7报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 投资组合报告

5.1 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	90,678.00	0.13
	其中:股票	90,678.00	0.13
2	基金投资	58,694,630.53	85.55
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,678,730.23	9.73
8	其他资产	3,146,444.05	4.59
9	合计	68,610,482.81	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	海富通基金管理有限公司	58,694,630.53	93.99

5.3 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	43,836.00	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,830.00	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	21,012.00	0.03
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	90,678.00	0.15

5.4 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

代码	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	601633	长城汽车	800	34,208.00	0.05
2	600900	长江电力	1,800	25,830.00	0.04
3	600153	建发股份	1,200	21,012.00	0.03
4	601216	内蒙君正	400	9,628.00	0.02

5.5 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。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。

5.7 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。

5.8 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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.9 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。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1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。

5.12.2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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	70,761.09
2	应收证券清算款	3,041,465.63
3	应收股利	-
4	应收利息	1,053.94
5	应收申购款	33,163.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,146,444.05

5.12.4 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。

5.12.5 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	600153	建发股份	21,012.00	0.03	重大事项
2	601216	内蒙君正	9,628.00	0.02	重大事项
3	601633	长城汽车	34,208.00	0.05	重大事项
4	600900	长江电力	25,830.00	0.04	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	40,698,662.47
本报告期基金总申购份额	122,624,281.13
减:本报告期基金总赎回份额	122,142,146.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	41,180,797.47

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于2003年4月,是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从2003年8月开始,海富通先后募集成立了32只公募基金。截至2015年6月30日,海富通管理的公募基金资产规模超过451亿元人民币。

作为国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人,截至2015年6月30日,海富通为80多家企业超过391亿元的企业年金基金担任了投资管理人。作为首批特定客户资产管理业务资格的基金管理公司,截至2015年6月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模超过124亿元。2010年12月,海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012年9月,中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014年8月,海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理公司正式开业,获准开展特定客户资产管理服务。

2004年末开始,海富通为QFII(合格境外机构投资者)及其他多个海内外投资组合担任投资咨询顾问,截至2015年6月30日,投资咨询及海外业务规模超过144亿元人民币。2011年12月,海富通全资子公司——海富通资产管理(香港)有限公司获得证监会核准批复RQFII(人民币合格境外机构投资者)业务资格,能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012年2月,海富通资产管理(香港)有限公司已募集发行了首只RQFII产品。

海富通同时还在不断践行其社会责任。公司自2008年启动"绿色与希望-橄榄枝公益环保计划",针对汶川震区受灾学校、上海民工小学、安徽老区小学进行了物资捐赠,向内蒙古库伦旗捐建了环保公益林。几年来,海富通的公益行动进一步升级,持续为上海民工小学学生捐献生活物资,并向安徽农村小学捐献图书室。此外,海富通还积极推进投资者教育工作,推出了以"幸福投资"为主题和特色的投资者教育活动,向投资者传播长期投资、理性投资的理念。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
(一)中国证监会批准设立海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金的文件
(二)海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同
(三)海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书
(四)海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议
(五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
(六)报告期内海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点
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层本基金管理人办公地址。

9.3 查阅方式
投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇一五年七月十八日

上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金

【2015】第二季度报告

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
报告送出日期:二〇一五年七月十八日

§1 重要提示

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7月17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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通上证非周期ETF
基金主代码	510120
交易代码	510120
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年4月22日
报告期末基金份额总额	20,692,376份
投资目标	紧密跟踪上证非周期行业100指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
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。
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
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	26,152,165.10
2.本期利润	16,712,066.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.5034
4.期末基金资产净值	77,871,293.54
5.期末基金份额净值	3.763

注:(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

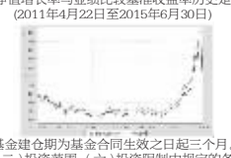
(3)本基金已于2011年5月18日进行了基金份额折算,折算比例为0.42126887。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	13.28%	2.78%	13.92%	2.91%	-0.64%	-0.13%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011年4月22日至2015年6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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘璎	本基金的基金经理;海富通上证非周期ETF联接基金经理;海富通上证周期ETF基金经理;海富通上证周期ETF联接基金经理;海富通中证100指数(LOF)基金经理;海富通中证内地低碳指数基金经理;指数投资部指数投资负责人	2011-04-22	-	14年	管理学硕士,持有基金从业人员资格证书。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。2012年5月起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。

注:1、对基金的首任基金经理,其任职日期指基金合同生效日,离任日期指公司做出决定之日;非首任基金经理,其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准:自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司根据证监会2011年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求,持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时,公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司建立了严格的投资交易行为监控制度,公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部、监察稽核部和风险管理部组成,各部门各司其职,对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控,保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内,公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析,并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)同向交易的样本,对其进行了95%置信区间,假设溢价率为0的T分布检验,检验结果表明,在T日、T+3日和T+5日不同循环期内,不管是买入或是卖出,公司各组合间买卖价差不显著,表明报告期内公司对旗下各基金进行了公平对待,不存在各投资组合之间进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

进入2015年二季度,经济进一步下行,A股市场巨幅震荡,经历了冲高回落的过山车行情。4月初至5月下旬,大盘指数均维持了此前的稳步上行趋势。"5.28"当日,沪指大跌6.5%,随即市场进入震荡期,6月中旬沪指上攻至5000点后,指数旋即大跌,6月底沪指重回4200点附近。

政策面方面,无论财政政策还是货币政策均是暖风不断。多家官方媒体撰文强调经济面临较大压力局势下股市的重要意义;国企改革、一带一路、京津冀、中国制造2025等主题的相关政策不断充实;央行更是频频出手为市场注入流动性,4月20日起央行存款准备金率下调1个百分点,5月8日央行降息0.25个百分点,6月27日央行祭出"定向宽松+降息"的组合拳。

指数方面,各主要市场指数历经震荡,仍然全部收涨。整个二季度,上证综指、深证成指分别上涨14.12%、10.41%;而中小板指和创业板指涨幅则高达15.32%、22.42%。行业方面,就中信证券一级行业指数而言,二季度仅非银行金融收跌,其余行业悉数上涨。其中,国防军工、交通运输、轻工制造、机械等板块涨幅居前,均上涨35%以上。在"国家意志+军民融合"背景下,国防军工行业二季度涨幅超40%,受到投资者的青睐。

作为指数基金,在操作上我们严格遵守基金合同,应用指数复制策略和数量化手段提高组合与指数的拟合度,降低跟踪误差。

4.5报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为13.28%,同期业绩比较基准收益率为13.92%。年跟踪误差为1.86%,日均跟踪偏离度的绝对值为0.0050%,在合同规定的目标控制范围之内。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,政府有望继续延续既有的货币政策和财政政策,宏观经济将触底企稳。至于A股市场,市场参与者的热情随着二季度末的大跌而迅速降温,且对市场资金面拐点到来的担忧迅速上升,从而对市场走势构成制约。基于此,三季度预计将出现宽幅振荡格局。但在牛市格局下,类似振荡有望夯实市场基础,为今后上行创造条件,与此同时结构性机会预计将层出不穷。

未来,本基金将继续严格按照基金合同的要求,秉承指数化投资策略,提高组合与指数的拟合度。

4.7报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5投资组合报告

5.1 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	76,233,909.32	97.06
	其中:股票	76,233,909.32	97.06
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	2,162,374.11	2.75
7	其他资产	145,010.78	0.18
8	合计	78,541,294.21	100.00

5.2 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	648,423.82	0.83
B	采矿业	-	-
C	制造业	42,027,047.67	53.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,588,066.46	12.31
E	建筑业	9,966,729.62	12.80
F	批发和零售业	2,745,205.19	3.53
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	8,707,349.57	11.18
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	988,616.00	1.27
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	1,562,470.99	2.01
S	综合	-	-
	合计	76,233,909.32	97.90

5.3 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	601766	中国中车	200,125	3,674,295.00	4.72
2	601989	中国重工	209,206	3,096,248.80	3.98
3	600887	伊利股份	139,070	2,628,423.00	3.38
4	601668	中国建筑	300,182	2,494,512.42	3.20
5	600519	贵州茅台	8,777	2,261,394.05	2.90
6	601390	中国中铁	147,759	2,022,820.71	2.60
7	600900	长江电力	140,130	2,010,865.50	2.58
8	600104	上汽集团	76,550	1,730,030.00	2.22
9	600795	国电电力	229,101	1,596,833.97	2.05
10	600637	百视通	37,445	1,575,685.60	2.02

5.4 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。

5.5 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。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,464.94
2	应收证券清算款	137,836.36
3	应收股利	-
4	应收利息	709.48
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	145,010.78

5.11.4 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。

5.11.5 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	2,010,865.50	2.58	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	26,092,376
本报告期基金总申购份额	323,700,000
减:本报告期基金总赎回份额	329,100,000
本报告期基金拆分变动份额	-