上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

海富通基金管理有限公司
公告日期：2017年4月18日
上市日期：2017年4月21日

一、重要声明与提示

《上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书》（以下简称“本公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号（上市交易公告书的内容与格式）》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，海富通基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。本基金托管人交通银行股份有限公司保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2016年11月11日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和海富通基金管理有限公司网站（www.hftfund.com）上的《上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金二级市场交易简称：周期债。
2、二级市场交易代码：511230。
3、基金申购赎回代码：511231。
4、申购赎回代码：511231。
5、2017年4月14日基金份额总额：2,107,636份。
6、2017年4月14日基金份额净值：100.4073元。
7、本次上市交易份额：2,107,636份。
8、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
9、上市交易日期：2017年4月21日。
10、基金管理人：海富通基金管理有限公司。
11、基金托管人：交通银行股份有限公司。
12、上市推荐人：海通证券股份有限公司。
13、申购赎回代办券商（以下简称“一级交易商”）：东方证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中万宏源证券有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司共6家证券公司。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况
1、基金募集申请的核准机构和核准文号：2016年10月8日经中国证券监督管理委员会证监许可【2016】2317号文准予注册。
2、基金运作方式：交易型开放式。
3、基金合同期限：不定期。
4、发售日期：本基金自2016年11月15日起至2017年1月13日止通过销售机构公开发售。其中，网下现金发售期间为2016年11月15日起至2017年1月13日，网上现金发售日期为2017年1月11日起至2017年1月13日，网下债券认购的发售期间为2016年11月15日起至2017年1月13日。
5、发售价格：1.00元人民币。
6、发售期限：网下现金发售43个工作日，网上现金发售3个工作日，网下债券认购43个工作日。
7、发售方式：投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购3种方式。
8、发售机构
（1）直销机构
投资者可通过本基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金认购和网下债券认购。
（2）代销机构
本基金的网下现金认购与网下债券认购的发售代理机构：海通证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司。
本基金网上现金发售代理机构为具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司。

（二）基金合同生效
上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金自2016年11月15日起向社会公开募集，截至2017年1月13日募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，此次募集的有效净认购金额为人民币209,251,616.00元（含所募集债券市值）。依照《上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，认购资金的银行利息12,998.00元折算成基金份额已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。本次募集认购资金已于2017年1月19日全额划入本基金在基金托管人交通银行股份有限公司开立的基金托管专户，所募集债券已于2017年1月18日由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理过户，按照每份基金份额面值人民币1.00元计算，本基金募集期间募集本金（含所募集债券市值）共募集209,264,614.00份基金份额，有效认购户数为883户。其中本基金管理人及本基金管理人的从业人员没有认购本基金。

按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金已符合基金合同生效条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2017年1月23日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

（三）基金份额折算
根据《上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，海富通基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）确定2017年3月28日为上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金的基金份额折算日。

基金份额折算方法为：折算后基金份额持有人持有的基金份额=折算前基金份额持有人持有的基金份额/100

折算后的基金份额以舍去方式保留至整数位，尾差计入基金财产。

本基金管理人根据上述折算方法于2017年3月28日对基金份额持有人认购的基金份额进行了折算。本基金折算前基金份额总额为209,264,614份，折算前基金份额净值为1.0039元；根据本基金的基金份额折算方法，折算后基金份额总额为2,092,646份，折算后基金份额净值为100.3910元。折算后的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，由此产生的误差计入基金财产。

本基金的登记机构中国证券登记结算有限责任公司于2017年3月29日进行了变更登记。基金份额持有人可以自2017年3月30日起在其上海证券交易所证券账户指定的销售机构查询折算后其持有的基金份额。

本基金管理人和基金托管人已根据折算后的基金份额总额进行了相应的会计处理，并互相核对。

（四）本基金日常申购、赎回情况
本基金已于2017年4月13日起开放申购，并于2017年4月14日起暂停申购，基金管理人在重新接受申购日、赎回开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（五）基金上市交易
1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书【2017】104号。
2、上市交易日期：2017年4月21日。
3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
4、基金二级市场交易简称：周期债。
5、二级市场交易代码：511230。
投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。
6、基金申购赎回简称：周期债。
7、申购赎回代码：511231。
投资者应当在本基金指定的一级交易商办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

目前本基金的一级交易商包括：东方证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中万宏源证券有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司共6家证券公司。

8、本次上市交易份额：2,107,636份。
9、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数
截至2017年4月14日，本基金份额持有人户数为1,493户，平均每户持有的基金份额为1,411份。

（二）持有人结构
截至2017年4月14日，本基金份额持有人结构如下：
机构投资者持有的基金份额为2,082,786份，占基金总份额98.82%；个人投资者持有的基金份额为24,850份，占基金总份额的1.18%。

（三）前十名基金份额持有人的情况：
截至2017年4月14日。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占场内总份额比例（%）
1	创金合信基金－招商银行－华润深国投信托－华润信托·鑫睿5号单一资金信托	1,000,060	47.45
2	生命保险资管－招商银行－生命资产睿智5号资产管理产品	300,018	14.23
3	平安资管－邮储银行－MOM2号保险资产管理产品	200,018	9.49
4	东方证券股份有限公司	200,012	9.49
5	招商财富－招商银行－华润信托－华润信托·鑫睿2号单一资金信托计划	200,002	9.49
6	太平养老金溢泓混合型养老金产品－交通银行股份有限公司	72,853	3.46
7	中国电信集团公司企业年金计划－中国银行股份有限公司	39,925	1.89
8	济南铁路局企业年金计划－中国工商银行股份有限公司	29,944	1.42
9	东北电网有限公司企业年金计划－招商银行	19,962	0.95
10	哈尔滨铁路局企业年金计划－中国工商银行股份有限公司	9,981	0.47

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人
1、基本情况
名称：海富通基金管理有限公司
法定代表人：张文伟（代行总经理职责）
注册资本：1.5亿元人民币
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
批准设立机关及设立批准文号：中国证监会证监基金字【2003】48号
统一社会信用代码：913100007109362411R
信息披露负责人：裘万荣
咨询电话：021-38650999
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。
股权结构：海通证券股份有限公司51%、法国巴黎投资管理BE控股公司49%。
2、内部组织结构及职能：
截至2016年12月31日，公司共有员工263人（包含子公司），人员组织结构如下所示：

部门名称	部门职能分工
总裁办	协助公司总经理进行日常管理，协调、监督和评估日常工作的推进和落实；协助总经理拟定、推动和评估公司战略。
行政部	负责处理公司日常行政事务。
人力资源部	负责公司人力资源的开发与管理，负责拟定和执行公司的薪酬福利计划，负责公司员工的绩效考核以及公司员工之间的关系维护。
财务部	负责公司财务管理，编制公司财务报告；在总经理的领导下，实施自有资产的投资管理；公司财产的其它职责。
监察稽核部	履行监察稽核职能，负责对公司业务运作的各个步骤和各个环节，以及业务流程的合法合规性进行审核。
风险管理部	负责公司的风险管理与投资绩效评估工作。其主要职责包括：负责落实风险管理委员会的各项风险管理决策和各项风险管理制度，进行必要的跨部门协调；对风险管理委员会的风险管理决策和公司各项风险管理制度的执行情况进行检查，评估和报告，为有关风险识别、管理决策和管理制度的评估和调整提供依据；根据外部环境变化和公司新业务的开展提出改进和完善风险管理的建议；定期对投资部所有组合进行绩效归因评估与分析工作，向管理层汇报并与投资部定期沟通，持续监控公司投资绩效工作。
法律部	参与协调公司决策，经营和管理中的法律事务，并对相关法律风险提出防范意见；起草、管理、审查公司合同，处理公司相关法律事务；受公司委托，参加公司的诉讼、非诉讼等活动。
权益投资部	负责对公募业务的权益类头寸进行投资管理，以追求相对收益为原则，在严格控制风险的前提下，通过资产配置策略和个股精选策略，实现组合资产的增值；指数化产品紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
机构权益投资部	负责对非公募业务的权益类头寸进行投资管理，以追求绝对收益为原则，充分运用多种权益投资策略和工具，实现客户资产的增值。
固定收益部	负责固定收益类资产配置工作，追求稳定收益，实现资产增值。下设债券基金部、年金专户固定收益部、固定收益研究部。
量化投资部	构建并维护海富通量化投资平台，海富通量化体系包括并不限于，择时、选股、交易策略、风险控制、绩效评估等方面。
研究部	管理各类资产，以量化投资策略为主，辅助市场中的各类投资机会，并且采用有效的风险管理措施，降低波动风险的同时，为客户提供稳定的绝对收益，以及具备超额收益的相对收益。
多资产策略投资部	管理多资产配置产品，协助机构业务部提供资产配置的解决方案，支持投研团队的资产配置决策。
专项资产管理部	主要负责承接机构客户的专项资金委托。职责包括：沟通了解客户需求，为客户定制专项资产管理计划方案；负责专项资产管理计划合同签署以及报备工作；根据定制方案，管理客户的委托资产；为客户提供投后管理服务，编制发送定期报告或临时报告等。
研究部	研究部的职能是：1、通过持续跟踪分析宏观经济形势、行业变化、公司基本面情况，为公司权益投资相关部门提供统一的投资建议与支持；2、作为公司权益投资后备力量的培养中心，为权益投资部门培养与输送合适的投资人才。
交易部	基金投资管理实行集中交易管理制度，具体操作由交易部负责。交易部主要是根据基金经理的投资指令，进行基金资产的日常交易活动，对交易情况及时反馈，并对投资指令进行监督。
产品与创新部	负责公司所有新产品和新业务的开发拓展。职责包括：公募基金产品规划与产品设计、上报、营销支持；完善公司产品线，丰富公司产品储备，负责产品管理和创新产品研究工作；协调国际业务，推动发展QFII以及RQFII海外资产管理等工作。
机构业务部	机构业务部服务对象为有投资理财需求的高净值个人投资者、机构投资者、养老金客户及帮助公司销售基金或机构业务的第三方独立机构，以及公募机构客户的开发和服务。
渠道业务部	研究公司渠道业务发展战略及经营管理策略；研究机构投资者和个人投资者的需求研究和投资行为，确立和影响开拓基金或相关投资服务形式的目标客户群体；跟踪市场发展变化，积极开拓相关业务发展领域和产品；负责公司开放式基金、专户理财及其他业务的营销及相关准备。
营销部	营销部的主要职责为负责公司形象和品牌的建立；有效提升公司媒体影响力和知名度；对接证监会认可的国内评级评价机构以及海外评级机构；负责市场业务的宣传推广及营销支持工作，积极协助公司其它部门的相关工作；负责投资者教育工作。
电子商务部	主要职责是与支付清算机构和互联网平台开展合作，负责三方销售渠道、客户的开拓，沟通与服务工作；积极探索基金产品互联网销售模式，同时为投资者提供便捷的基金交易手段，有效提升客户体验。
运营部	运营部由信息技术部和基金会计部组成。 信息技术部负责公司信息系统规划、管理和技术支持与协调工作，并对公司信息技术信息系统、设备、人员进行管理，保障公司业务系统的正常运行及信息安全。 基金会计部负责基金的会计核算与估值，负责基金的登记过户与资金清算业务，以及其他各类与业务相关的运营支持业务。
北京分公司	负责北京公司工作，建立并维护与政府及证券监管部门的有效沟通渠道和机制，保持政策、业务信息的通畅，协助完成相关行政许可的批准以及新业务等相关工作。
上海富诚海富通资产管理有限公司	富诚子公司职能分工：负责一级市场股权投资业务、非标准化债权投资业务、资产证券化业务以及综合金融服务业务等，和海富通基金（母公司）的二级市场标准业务形成一个有机的整体。
海富通资产管理（香港）有限公司	负责为海外客户提供投资境内证券市场QFII、RQFII投资管理、投资咨询业务，为境内客户提供投资海外证券市场投资管理、投资咨询业务。

2、基金管理业务情况简介：
从2003年8月开始，海富通先后募集成立了43只公募基金。截至2016年12月31日，海富通管理的公募基金资产规模超过443亿元人民币。旗下管理的基金有海富通股票混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中小盘混合型证券投资基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通精选混合型证券投资基金、海富通精选成长混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通养老收益混合型证券投资基金、海富通收益增长混合型证券投资基金、海富通内需增长混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通改革驱动混合型证券投资基金、海富通领先优势混合型证券投资基金、海富通祥混合型证券投资基金、海富通成长混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通产业升级混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通稳进增利债券型证券投资基金(LOF)、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通双利债券型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通双福分级债券型证券投资基金、海富通上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞益债券型证券投资基金、海富通瑞丰一年定期开放债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通季季增利理财债券型证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通中证100指数证券投资基金（LOF）、上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金、上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金、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、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金。

3、本基金基金经理

陈轶平先生，博士，CFA。历任Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师，瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事，2011年10月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理，基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总监，现任固定收益投资部副总监兼债券基金部总监。2013年8月起任海富通货币基金经理。2014年8月起兼任海富通添利债券基金经理。2014年11月起兼任海富通上证可质押城投债ETF基金经理。2015年12月起兼任海富通稳固收益债券和海富通稳进增利债券（LOF）基金经理。2016年4月起兼任海富通一年定开债券基金经理。2016年7月起兼任海富通瑞益债券基金经理。2016年8月起兼任海富通瑞盈债券和海富通瑞丰一年定开债券基金经理。2016年11月起兼任海富通美元债（QDII）基金经理。2017年1月起兼任海富通上证周期产业债ETF基金经理。2017年2月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017年3月起兼任海富通富源债券和海富通瑞端合纯债基金经理。

（二）基金托管人
1、基本情况
公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）
公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人：牛锡明
住　所：上海市浦东新区银城中路188号
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码：200120
注册时间：1987年3月30日
注册资本：742.62亿元
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25号
联系人：陆志俊
电　话：95559

交通银行始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。根据2015年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第17位，较上年上升2位；根据2015年美国《财富》杂志发布的世界500强公司排行榜，交通银行营业收入位列第190位，较上年上升27位。

截至2016年9月30日，交通银行资产总额为人民币80,918.10亿元。2016年1-9月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币525.78亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

2、主要人员情况
牛锡明先生，董事长、执行董事。
牛先生2013年10月至今任本行董事长、执行董事，2013年5月至2013年10月任本行董事长、执行董事、行长，2009年12月至2013年5月任本行副董事长、执行董事、行长。牛先生1983年毕业于中央财经大学金融系，获学士学位，1997年毕业于哈尔滨工业大学管理学院技术经济专业，获硕士学位，1999年享受国务院颁发的政府特殊津贴。

彭纯先生，副董事长、执行董事、行长。
彭先生2013年11月起任本行副董事长、执行董事，2013年10月起任本行行长；2010年4月至2013年9月任中国投资有限责任公司副总经理兼中央汇金投资有限责任公司执行董事、总经理；2005年8月至2010年4月任本行执行董事、副行长；2004年9月至2005年8月任本行副行长；2004年6月至2004年9月任本行董事、行长助理；2001年9月至2004年6月任本行行长助理；1994年至2001年历任本行乌鲁木齐分行副行长、行长，南宁分行行长，广州分行行长。彭先生1986年于中国人民银行研究生部获经济学硕士学位。

袁庆生女士，资产托管业务中心总裁。
袁女士2015年8月起任本行资产托管业务中心总裁；2007年12月至2015年8月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理、本行资产托管业务中心副总裁；1999年12月至2007年12月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长、会计结算部高级经理。袁女士1992年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005年于新疆财经学院获硕士学位。

3、基金托管业务经营情况
截至2016年9月30日，交通银行共托管证券投资基金206只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、ODII证券投资资产和QDLP资金等产品。

（三）上市推荐人
1、名称：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：周杰
客户服务电话：021-95553或4008888001
联系人：李笑鸣
网址：www.htsec.com

（四）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：周杰
客户服务电话：021-95553或4008888001
联系人：李笑鸣
网址：www.htsec.com
（2）　东方证券股份有限公司
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
客户服务电话：95503
联系人：胡月姣
网址：www.dfzq.com.cn
（3）　国泰君安证券股份有限公司
地址：上海市浦东新区商城路618号
法定代表人：杨德红
传真：021-38670666
客户服务电话：95521
联系人：芮敏祺
网址：www.gtja.com
（4）　申万宏源证券有限公司
地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
法定代表人：李梅
客户服务电话：95523或4008895523
联系人：黄莹
网址：www.swhysc.com
（5）　中信证券股份有限公司
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
电话：95548
联系人：顾凌
网址：www.cs.ecitic.com
（6）　中信证券(山东)有限责任公司
地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
法定代表人：杨宝林
客户服务电话：95548
联系人：赵艳青
网址：www.citicssd.com
（五）基金验资机构
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：陈玲、都晓燕
电话：(021) 23238888
传真：(021) 23238800
联系人：都晓燕

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用
本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用从基金认购费用中支付，不由基金资产承担。

（二）基金上市前重要财务事项
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表
本基金截至2017年4月14日的资产负债表如下：

资　产	本报告期末 2017年4月14日
资　产：	
银行存款	72,288,455.83
结算备付金	4,729,083.28
存出保证金	8,527.16
交易性金融资产	140,378,460.9
其中：股票投资	-
债券投资	140,378,460.9
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	3,947,362.5
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	-
资产总计	221,351,889.67
负债和所有者权益	本报告期末 2017年4月14日
负　债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	9,603,615.45
应付赎回款	-
应付管理人报酬	24,170.9
应付托管费	8,056.98
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
其他负债	94,033.55
负债合计	9,729,876.88
所有者权益：	
实收基金	210,763,611.55
未分配利润	858,401.24
所有者权益合计	211,622,012.79
负债和所有者权益总计	221,351,889.67

注：1、截至2017年4月14日，基金份额净值100.4073元，基金份额总额2,107,636.00份。
2、本报告期自2017年1月23日起至2017年4月14日止。本基金合同于2017年1月23日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满半年。

八、基金投资组合

截至2017年4月14日，本基金的投资组合情况如下：
（一）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	0	0
	其中：股票	0	0
2	固定收益投资	140,378,460.90	66.3%
	其中：债券	140,378,460.90	66.3%
	资产支持证券	0	0
3	金融衍生品投资	0	0
4	买入返售金融资产	0	0
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0	0
5	银行存款和结算备付金合计	77,017,539.11	36.4%
6	其他资产	3,955,889.66	1.9%
7	合计	221,351,889.67	104.6%

（二）截至 2017年4月14日，按行业分类的股票投资组合
无。
（三）截至2017年4月14日，按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细
无。
（四）按券种分类的债券投资组合

序号	券种类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	0	-
2	央行票据	0	-
3	金融债券	0	-
	其中：政策性金融债	0	-
4	企业债券	140,378,460.90	66.33
5	企业短期融资券	0	-
6	可转债	0	-
7	其他	0	-
8	合计	140,378,460.90	66.33

（五）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	136093.sh	15华信债	32,990	3,259,412.00	1.54%
2	124495.sh	14基金债	20,000	2,106,600.00	1.00%
3	122181.sh	12山鹰债	20,000	2,091,800.00	1.00%
4	122329.sh	14伊泰01	20,000	2,082,600.00	0.98%
5	122212.sh	12皖江01	20,800	2,076,880.00	0.98%

（六）投资组合报告附注
1、自基金合同生效日至2017年4月14日，本基金投资的前十名证券中没有出现发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
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。
3、其他资产构成如下：

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,527.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,947,362.5
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,955,889.66

4、权证投资情况
截至2017年4月14日，本基金未持有权证；自基金合同生效日至2017年4月14日，本基金未投资任何权证。
5、本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
截至2017年4月14日，本基金未持有可转换债券。
6、本报告期末按市值占基金净值比例大小排序的所有资产支持证券明细
截至2017年4月14日，本基金未持有资产支持证券。
7、投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

以2017年3月28日为基金份额折算日，本基金进行了基金份额折算，具体内容详见第三章的“（三）基金份额折算”。

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规，《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产。
（二）根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。
基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。
基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为海通证券股份有限公司。上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：
1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件；
2、基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

十三、备查文件目录

（一）中国证监会准予上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
（二）《上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
（三）《上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
（四）基金管理人业务资格批件、营业执照；
（五）基金托管人业务资格批件、营业执照；
（六）关于申请募集上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金之法律意见书。
备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可向基金管理人、基金托管人申请查阅。

海富通基金管理有限公司
2017年4月18日

附件：基金合同摘要

一、基金合同当事人及权利义务
（一）　基金管理人的权利与义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：
（1）依法募集资金；
（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
（3）依据《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
（4）销售基金份额；
（5）按照规定召集基金份额持有人大会；
（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；
（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
（12）依照法律法规为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换等的业务规则；
（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：
（1）依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
（2）办理基金备案手续；
（3）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
（6）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，向审计、法律等外聘专业顾问提供的除外；
（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回对价的现金部分；
（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
（10）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
（11）按照法律法规、基金合同规定的年限保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
（12）从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；
（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
（14）　依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价的现金部分；
（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
（18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
（19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（20）按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
（三）基金份额持有人
基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。
每份基金份额具有同等的合法权益。
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有