

**上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金**  
**2019 年半年度报告**  
**2019 年 6 月 30 日**

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：二〇一九年八月二十八日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2019 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、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，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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 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.....	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	43
7.8 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.....	43
7.9 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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	45
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	47
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	48
<b>§12 备查文件目录</b> .....	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

## §2 基金简介

### 2.1 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
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
报告期末基金份额总额	8,092,376 份
基金合同存续期	不定期
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

### 2.2 基金产品说明

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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	海富通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	奚万荣	郭明
	联系电话	021-38650891	010-66105799
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	40088-40099	95588	
传真	021-33830166	010-66105798	
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	北京市西城区复兴门内大街55号	
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	北京市西城区复兴门内大街55号	
邮政编码	200120	100140	
法定代表人	杨仓兵	陈四清	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2019年1月1日至2019年6月30日）
本期已实现收益	-509,472.26
本期利润	4,595,767.96
加权平均基金份额本期利润	0.5542

本期加权平均净值利润率	19.85%
本期基金份额净值增长率	22.46%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2019 年 6 月 30 日)</b>
期末可供分配利润	64,381.35
期末可供分配基金份额利润	0.0080
期末基金资产净值	23,731,016.11
期末基金份额净值	2.933
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2019 年 6 月 30 日)</b>
基金份额累计净值增长率	23.56%

注：1、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。

2、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。

3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

4、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 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	5.24%	1.14%	5.06%	1.18%	0.18%	-0.04%
过去三个月	-1.48%	1.51%	-1.83%	1.54%	0.35%	-0.03%
过去六个月	22.46%	1.46%	23.35%	1.50%	-0.89%	-0.04%
过去一年	3.17%	1.48%	4.11%	1.51%	-0.94%	-0.03%
过去三年	22.98%	1.09%	26.71%	1.12%	-3.73%	-0.03%
自基金合同生效起至今	23.56%	1.48%	14.39%	1.54%	9.17%	-0.06%

#### 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 2019 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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 61 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票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、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证



券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、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、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通双福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、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥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、海富通瑞丰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、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通富睿混合型证券投资基金、海富通季季通利理财债券型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
江勇	本基金的基金经理；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；海富通上证非周期	2018-07-10	-	8 年	经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。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

	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。				上证非周期 ETF 联接、海富通中证 100 指数(LOF)、海富通中证内地低碳指数的基金经理。
纪君凯	本基金的基金经理助理；海富通上证非周期 ETF 联接基金经理助理；海富通上证周期 ETF 联接基金经理助理；海富通上证周期 ETF 基金经理助理；	2018-07-28	-	2 年	上海财经大学统计学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任天风证券上海自营分公司衍生品部投资研究、期权交易职位。2017 年 7 月加入海富通基金管理有限公司，历任投资经理。2018 年 7 月起担任海富通上证周期 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 联接的基金经理助理。

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为：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合规守信情况的说明

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、勤勉尽职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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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、境外上市股票、债券、基金的一级市场申购、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、投资部门、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，保证本报告期内公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年 A 股市场出现了明显涨幅。截至 2019 年 6 月 30 日，上证综指收于 2978.88 点，上半年上涨 19.45%，深证成指收于 9178.31 点，上涨幅度为 26.78%。中小板指收于 5678.75 点，上涨 20.75%，创业板上涨 20.87%，报 1511.51 点。

具体来看，自从 1 月 4 日上证综指盘中触及近三年新低 2440.91 点之后，市场便开始温和反弹，一直延续到月底，1 月份上证综指涨幅 3.64%。板块上，家电、食品饮料、保险、银行等价值权重板块率先企稳反弹，涨幅居前。进入 2 月份，随着困扰 2018 年的几大利空因素均有所缓解：中美贸易摩擦的积极向好谈判、监管层对去杠杆告一段落等，2 月份上证综指涨幅达到 13.79%，创近几年新高。同时随着 2 月末两市单日总成交量放大到万亿、融资余额回到 8000 亿以上，市场风险偏好大幅上升。趋势延续到 3 月，当月上证综指上涨 5.09%，表现依旧不错。进入二季度，一季度大幅上涨之后，4 月份存在一定的调整压力。因此在月初上证综指触及短期新高 3288.45 点之后，便开始区间震荡。同时月底贸易谈判陷入僵局，指数也开始出现回调。4 月份上证综指下跌 0.4%。5 月初随着中美贸易谈判陷入僵局，以及对国内宏观经济下行压力的预期，市场出现了大幅回调，单 5 月份上证综指下跌 5.84%，深证成指下跌 7.77%。板块上看，仅有以黄金为代表的有色板块涨幅 2.2%，其他板块悉数下跌，其中禽畜产业链、食品饮料等相对跌幅较少，而 TMT 板块、券商等高弹性板块跌幅居前。进入 6 月份之后，虽然 4-5 月份的宏观经济数据依旧没有改善预期，但随着对中美 G20 重启贸易谈判的预期，市场逐步开始筑底回升，风险偏好有所提升，单 6 月上证综指上涨 2.77%。

行业方面，在申万 28 个一级行业分类中，上半年均录得涨幅，单板块间差异巨大。其中食品饮料（61.01%）、非银金融（43.83%）、农林牧渔（41.96%）、家电（37.82%）、计算机（32.77%）涨幅排名前五，且都涨幅超过 30%。而建筑装饰（4.16%）、钢铁（5.04%）、传媒（7.79%）、纺织服装（9.27%）、汽车（10.03%）涨幅靠后。

报告期内，本基金完成了年中的指数成分股调整。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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 22.46%，同期业绩比较基准收益率为 23.35%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年初，市场对经济的担忧有所缓解。外部中美贸易摩擦暂缓，并貌似朝着达成协议的方向演进。内部政策宽松，降准、地方债发行前置、信贷周期回暖，资产价格预期企稳。2019 年 4 月中旬，国内外不确定性上升。4 月中旬起国内政策边际收紧，5 月初中美局势恶化，5 月 24 日包商银行被接管，中小银行结构性去杠杆。市场风险偏好显著回落。2019 年 6 月中旬，中美领导人通电话，确定 G20 见面，市场预期谈判重启；美联储 6 月议息会议释放鸽派信号；证监会就修改《上市公司重大资产重组管理办法》征求意见，市场风险偏好迅速提升。上半年的行情基本上来源于估值修复。

下半年，国内宏观经济增长压力仍在。一季度在信贷及社融扩张提振下，经济增长体现一定韧性，但随着外部中美贸易摩擦带来的负面效果更大范围地显现，内部房地产市场可能逐步降温、基建增速制约重重、中小银行去杠杆对实体经济的影响尚未完全体现等，中国经济增长在 2019 年下半年仍将面临压力。同时，从政策角度看，下半年宏观政策倾向将维持宽松，尤其是三季度将在边际上较二季度宽松。但在高杠杆环境以及结构性去杠杆政策背景制约下，政策效果有待验证。同时，包商银行事件后，流动性出现分层，中小银行及非银机构融资困难程度及成本上升，为避免出现局部风险，预计货币政策将采取进一步措施缓解结构性流动性压力。

从中期角度，我们依旧对下半年的资本市场保持相对乐观。我们认为估值的变化依然是核心变量，仍存在修复机会。估值端来自无风险利率下行带来的修复机会较为确定，风险偏好短期将出现抬升，但后续存在不确定性，整体上市场环境好于二季度，策略上更加积极，但需留意市场可能会阶段性对业绩下滑做出负面反应。从行业角度看，我们认为科技、消费、金融等板块有望持续跑出超额收益，包括计算机、半导体、5G、食品饮料、医药、券商、银行等。

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。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理负责人、合规负责人、风险管理负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会下设估值工作小组，估值工作小组对经济

环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人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标的指数同期累计报酬率达到 1% 以上，基金管理人可进行收益分配。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2015 年 8 月 24 日至 2019 年 6 月 30 日，已连续超过六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形，基金管理人拟通过与其他基金合并转型的方式解决。解决方案已根据法规要求向中国证券监督管理委员会进行了报告。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对上证非周期行业 100 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 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——海富通基金管理有限公司在上证非周期行业 100 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、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	638,869.89	682,240.04
结算备付金		1,262.40	506.10
存出保证金		247.62	331.87
交易性金融资产	6.4.7.2	23,215,512.51	19,670,135.80
其中：股票投资		23,215,512.51	19,670,135.80
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	111.34	136.70
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>23,856,003.76</b>	<b>20,353,350.51</b>
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,414.25	8,712.36
应付托管费		1,882.84	1,742.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,137.78	2,136.91
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	111,552.78	245,000.00
负债合计		124,987.65	257,591.76
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	19,209,866.75	19,922,013.59
未分配利润	6.4.7.10	4,521,149.36	173,745.16
所有者权益合计		23,731,016.11	20,095,758.75
负债和所有者权益总计		23,856,003.76	20,353,350.51

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.933 元，基金份额总额 8,092,376.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>4,830,590.60</b>	<b>-1,595,886.91</b>
1.利息收入		2,478.88	2,877.76
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,478.88	2,877.76
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）		-275,709.50	-209,599.93

其中：股票投资收益	6.4.7.12	-481,073.43	-453,895.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	205,363.93	244,296.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,105,240.22	-1,389,448.99
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-1,419.00	284.25
<b>减：二、费用</b>		<b>234,822.64</b>	<b>288,497.63</b>
1. 管理人报酬		57,209.78	67,266.20
2. 托管费		11,441.99	13,453.18
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,434.09	5,915.22
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	161,736.78	201,863.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>4,595,767.96</b>	<b>-1,884,384.54</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>4,595,767.96</b>	<b>-1,884,384.54</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	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）	19,922,013.59	173,745.16	20,095,758.75



二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,595,767.96	4,595,767.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-712,146.84	-248,363.76	-960,510.60
其中：1.基金申购款	2,136,440.53	337,498.40	2,473,938.93
2.基金赎回款	-2,848,587.37	-585,862.16	-3,434,449.53
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	19,209,866.75	4,521,149.36	23,731,016.11
项目	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	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)	22,770,600.96	6,632,979.80	29,403,580.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,884,384.54	-1,884,384.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,136,440.53	-668,797.43	-2,805,237.96
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-2,136,440.53	-668,797.43	-2,805,237.96
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	20,634,160.43	4,079,797.83	24,713,958.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：陶网雄，会计机构负责人：胡正万

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 268 号《关于核准上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 652,293,929.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 143 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 4 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 652,308,409.00 份基金份额，其中通过直销机构网下现金认购部分的认购资金利息折合 14,480.00 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司确定 2011 年 5 月 18 日为本基金的基金份额折算日。当日上证非周期行业 100 指数收盘值为 2,341.426 点，基金资产净值为 643,417,367.51 元，折算前基金份额总额为 652,308,409 份，折算前基金份额净值为 0.986 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.42126887，折算后基金份额总额为 274,792,376.00 份，折算后基金份额净值为 2.341 元。海富通基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2011 年 5 月 19 日进行了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2011]第 105 号文审核同意，本基金于 2011 年 6 月 8 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数上证非周期行业 100 指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化；主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股，该部分资产比例不低于基金资产净值的 90%；本基金也少量投资于新股、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%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为上证非周期行业 100 指数。

本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2011 年 4

月 27 日募集成立了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(以下简称“上证非周期行业 100ETF 联接基金”)。上证非周期行业 100ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2019 年 8 月 27 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2019 年 6 月 30 日,本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于

进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	638,869.89

定期存款	-
其他存款	-
合计	638,869.89

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	22,201,544.17	23,215,512.51	1,013,968.34
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	22,201,544.17	23,215,512.51	1,013,968.34

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产 / 负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	110.71
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	0.54
应收债券利息	-

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.09
合计	111.34

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,137.78
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,137.78

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付指数使用费	50,000.00
预提费用	61,552.78
合计	111,552.78

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,392,376.00	19,922,013.59
本期申购	900,000.00	2,136,440.53
本期赎回（以“-”号填列）	-1,200,000.00	-2,848,587.37
本期末	8,092,376.00	19,209,866.75

注：投资者申购和赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	572,095.66	-398,350.50	173,745.16
本期利润	-509,472.26	5,105,240.22	4,595,767.96
本期基金份额交易产生的变动数	1,757.95	-250,121.71	-248,363.76
其中：基金申购款	65,327.32	272,171.08	337,498.40
基金赎回款	-63,569.37	-522,292.79	-585,862.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	64,381.35	4,456,768.01	4,521,149.36

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,455.44
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	20.86
其他	2.58
合计	2,478.88

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-408,308.11
股票投资收益——赎回差价收入	-72,765.32
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-481,073.43

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,504,073.08

减：卖出股票成本总额	1,912,381.19
买卖股票差价收入	-408,308.11

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
赎回基金份额对价总额	3,434,449.53
减：现金支付赎回款总额	147,404.53
减：赎回股票成本总额	3,359,810.32
赎回差价收入	-72,765.32

#### 6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无申购差价收入。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	205,363.93
基金投资产生的股利收益	-
合计	205,363.93

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	5,105,240.22
——股票投资	5,105,240.22
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-



——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	5,105,240.22

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-1,419.00
合计	-1,419.00

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	4,434.09
银行间市场交易费用	-
合计	4,434.09

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	4,526.92
上市费	29,752.78
银行划款手续费	184.00
指数使用费	100,000.00

合计	161,736.78
----	------------

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币 50,000 元。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
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(“上证非周期行业 100ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	2,872,393.08	100.00%	4,017,413.12	100.00%

### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	2,674.99	100.00%	2,137.78	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	3,741.64	100.00%	2,683.96	100.00%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	57,209.78	67,266.20
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.5% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年
----	-----------------------	----------------------------

	6月30日	6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,441.99	13,453.18

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
上证非周期行业 100ETF 联接基金	5,096,229.00	62.98%	5,396,229.00	64.30%

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	638,869.89	2,455.44	958,729.02	2,816.70

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

### 6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限的证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600485	信威集团	2016-12-26	重大资产重组	6.28	2019-07-12	13.86	3,327	21,757.44	20,893.56	-

注：本基金截至 2019 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪上证非周期行业 100 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。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪上证非周期行业 100 指数，以完全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为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及

重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和监察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资(2018 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 6 月 30 日,本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.09%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	638,869.89	-	-	-	638,869.89
结算备付金	1,262.40	-	-	-	1,262.40
存出保证金	247.62	-	-	-	247.62
交易性金融资产	-	0.00	0.00	23,215,512.51	23,215,512.51
应收利息	-	-	-	111.34	111.34
<b>资产总计</b>	<b>640,379.91</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>23,215,623.85</b>	<b>23,856,003.76</b>
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	9,414.25	9,414.25
应付托管费	-	-	-	1,882.84	1,882.84
应付交易费用	-	-	-	2,137.78	2,137.78
其他负债	-	-	-	111,552.78	111,552.78
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>124,987.65</b>	<b>124,987.65</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>640,379.91</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>23,090,636.20</b>	<b>23,731,016.11</b>
<b>上年度末</b>	<b>1年以内</b>	<b>1至5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>



<b>2018 年 12 月 31 日</b>					
<b>资产</b>					
结算备付金	506.10	-	-	-	506.10
存出保证金	331.87	-	-	-	331.87
交易性金融资产	-	-	-	19,670,135.80	19,670,135.80
应收利息	-	-	-	136.70	136.70
银行存款	682,240.04	-	-	-	682,240.04
<b>资产总计</b>	<b>683,078.01</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>19,670,272.50</b>	<b>20,353,350.51</b>
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	8,712.36	8,712.36
应付托管费	-	-	-	1,742.49	1,742.49
应付交易费用	-	-	-	2,136.91	2,136.91
其他负债	-	-	-	245,000.00	245,000.00
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>257,591.76</b>	<b>257,591.76</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>683,078.01</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>19,412,680.74</b>	<b>20,095,758.75</b>

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，跟踪上证非周期行业 100 指数，以完全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为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，上证非周期行业 100 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 90%，新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具投资比例不高于基金资产净值的 10%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	23,215,512.51	97.83	19,670,135.80	97.88
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	23,215,512.51	97.83	19,670,135.80	97.88

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 6.4.1）以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
1. 业绩比较基准(附注 6.4.1) 上升 5%		增加约 114	增加约 96
2. 业绩比较基准(附注 6.4.1) 下降 5%		减少约 114	减少约 96

注：金额为约数,精确到万元。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	23,215,512.51	97.32
	其中：股票	23,215,512.51	97.32
2	基金投资	-	-
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	640,132.29	2.68
8	其他各项资产	358.96	0.00
9	合计	23,856,003.76	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	15,865,918.23	66.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,801,396.80	7.59
E	建筑业	2,219,129.97	9.35
F	批发和零售业	742,295.31	3.13
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	1,753,374.20	7.39
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	621,900.00	2.62
M	科学研究和技术服务业	60,676.00	0.26
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	89,262.00	0.38
S	综合	61,560.00	0.26
	合计	23,215,512.51	97.83

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：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	600519	贵州茅台	3,375	3,321,000.00	13.99
2	600887	伊利股份	42,606	1,423,466.46	6.00
3	600276	恒瑞医药	20,741	1,368,906.00	5.77
4	601668	中国建筑	143,885	827,338.75	3.49

5	600900	长江电力	44,390	794,581.00	3.35
6	600104	上汽集团	24,791	632,170.50	2.66
7	601888	中国国旅	6,700	593,955.00	2.50
8	603288	海天味业	5,300	556,500.00	2.35
9	601766	中国中车	65,959	533,608.31	2.25
10	600031	三一重工	39,208	512,840.64	2.16
11	600309	万华化学	11,158	477,450.82	2.01
12	600690	海尔智家	26,048	450,369.92	1.90
13	600050	中国联通	64,859	399,531.44	1.68
14	601989	中国重工	63,720	354,283.20	1.49
15	601390	中国中铁	51,659	336,816.68	1.42
16	601186	中国铁建	33,678	335,096.10	1.41
17	600352	浙江龙盛	19,834	312,782.18	1.32
18	600570	恒生电子	4,562	310,900.30	1.31
19	601933	永辉超市	28,039	286,278.19	1.21
20	600436	片仔癀	2,300	264,960.00	1.12
21	600741	华域汽车	12,209	263,714.40	1.11
22	600406	国电南瑞	13,529	252,180.56	1.06
23	600588	用友网络	8,743	235,011.84	0.99
24	600886	国投电力	30,178	234,483.06	0.99
25	601669	中国电建	42,344	223,999.76	0.94
26	600795	国电电力	85,707	217,695.78	0.92
27	600703	三安光电	19,093	215,369.04	0.91
28	600196	复星医药	8,020	202,906.00	0.86
29	600271	航天信息	8,790	202,609.50	0.85
30	600438	通威股份	13,100	184,186.00	0.78

31	601985	中国核电	33,071	183,874.76	0.77
32	600011	华能国际	29,500	183,785.00	0.77
33	600089	特变电工	24,171	175,239.75	0.74
34	600487	亨通光电	10,360	173,633.60	0.73
35	600522	中天科技	18,678	171,277.26	0.72
36	603019	中科曙光	4,760	167,076.00	0.70
37	600332	白云山	4,009	164,248.73	0.69
38	601607	上海医药	8,548	155,146.20	0.65
39	601877	正泰电器	6,700	154,703.00	0.65
40	600893	航发动力	6,732	152,883.72	0.64
41	601800	中国交建	13,172	149,107.04	0.63
42	600066	宇通客车	11,163	145,342.26	0.61
43	600674	川投能源	15,018	133,660.20	0.56
44	600637	东方明珠	12,581	132,603.74	0.56
45	600068	葛洲坝	21,100	131,453.00	0.55
46	600809	山西汾酒	1,900	131,195.00	0.55
47	600739	辽宁成大	8,726	126,876.04	0.53
48	600867	通化东宝	8,100	124,740.00	0.53
49	601618	中国中冶	40,578	123,357.12	0.52
50	600535	天士力	7,222	119,524.10	0.50
51	600085	同仁堂	3,982	115,478.00	0.49
52	600482	中国动力	4,868	114,982.16	0.48
53	600600	青岛啤酒	2,300	114,839.00	0.48
54	601727	上海电气	21,100	113,518.00	0.48
55	600498	烽火通信	4,056	113,000.16	0.48
56	600426	华鲁恒升	7,600	112,936.00	0.48

57	603160	汇顶科技	800	111,040.00	0.47
58	600298	安琪酵母	3,400	107,542.00	0.45
59	600536	中国软件	2,000	107,340.00	0.45
60	601233	桐昆股份	6,700	103,917.00	0.44
61	600879	航天电子	16,700	102,872.00	0.43
62	603156	养元饮品	2,680	99,374.40	0.42
63	601138	工业富联	8,200	98,810.00	0.42
64	600118	中国卫星	4,306	97,100.30	0.41
65	600528	中铁工业	8,287	95,880.59	0.40
66	603986	兆易创新	1,100	95,370.00	0.40
67	600160	巨化股份	13,378	95,117.58	0.40
68	600760	中航沈飞	3,200	92,896.00	0.39
69	601117	中国化学	15,276	91,961.52	0.39
70	600038	中直股份	2,219	91,023.38	0.38
71	600699	均胜电子	4,204	89,797.44	0.38
72	600977	中国电影	5,700	89,262.00	0.38
73	600153	建发股份	10,001	88,808.88	0.37
74	603858	步长制药	3,440	88,648.80	0.37
75	600718	东软集团	6,868	88,047.76	0.37
76	600297	广汇汽车	19,100	85,186.00	0.36
77	600804	鹏博士	10,914	82,073.28	0.35
78	600446	金证股份	4,152	81,545.28	0.34
79	600584	长电科技	6,299	80,942.15	0.34
80	601633	长城汽车	8,470	70,046.90	0.30
81	603369	今世缘	2,500	69,725.00	0.29
82	600521	华海药业	4,900	69,090.00	0.29

83	601360	三六零	3,000	64,140.00	0.27
84	600435	北方导航	6,922	62,228.78	0.26
85	600895	张江高科	3,000	61,560.00	0.26
86	603259	药明康德	700	60,676.00	0.26
87	600372	中航电子	3,956	58,707.04	0.25
88	600346	恒力石化	4,760	57,881.60	0.24
89	600572	康恩贝	8,900	56,960.00	0.24
90	600025	华能水电	13,100	53,317.00	0.22
91	601216	君正集团	16,020	52,705.80	0.22
92	600566	济川药业	1,700	51,187.00	0.22
93	601238	广汽集团	4,640	50,715.20	0.21
94	600409	三友化工	7,500	42,450.00	0.18
95	600884	杉杉股份	3,900	41,535.00	0.18
96	603260	合盛硅业	600	28,236.00	0.12
97	601828	美凯龙	2,300	27,945.00	0.12
98	600485	信威集团	3,327	20,893.56	0.09
99	600733	北汽蓝谷	1,900	15,694.00	0.07
100	601615	明阳智能	1,400	15,176.00	0.06
101	603712	七一二	500	10,615.00	0.04

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600011	华能国际	196,430.00	0.98
2	603288	海天味业	189,529.00	0.94



3	600536	中国软件	108,592.00	0.54
4	600600	青岛啤酒	107,070.00	0.53
5	600298	安琪酵母	105,062.00	0.52
6	603156	养元饮品	89,952.00	0.45
7	600031	三一重工	69,768.00	0.35
8	600276	恒瑞医药	62,330.00	0.31
9	603369	今世缘	61,575.00	0.31
10	600895	张江高科	59,400.00	0.30
11	600572	康恩贝	53,608.00	0.27
12	603986	兆易创新	51,854.00	0.26
13	600566	济川药业	49,410.00	0.25
14	601668	中国建筑	40,104.00	0.20
15	601669	中国电建	35,843.00	0.18
16	600438	通威股份	33,000.00	0.16
17	601800	中国交建	19,908.00	0.10
18	600733	北汽蓝谷	16,432.00	0.08
19	601615	明阳智能	14,622.00	0.07
20	600584	长电科技	3,831.00	0.02

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	458,199.00	2.28
2	600023	浙能电力	143,957.44	0.72
3	600170	上海建工	128,424.62	0.64

4	600900	长江电力	93,851.00	0.47
5	600820	隧道股份	92,702.36	0.46
6	600518	ST 康美	77,026.08	0.38
7	600079	人福医药	70,577.63	0.35
8	600415	小商品城	63,556.02	0.32
9	600008	首创股份	61,716.00	0.31
10	600688	上海石化	56,496.13	0.28
11	600060	海信电器	49,047.80	0.24
12	600309	万华化学	34,983.00	0.17
13	600690	海尔智家	30,970.00	0.15
14	600276	恒瑞医药	30,222.00	0.15
15	600104	上汽集团	26,910.00	0.13
16	603659	璞泰来	23,416.00	0.12
17	600674	川投能源	20,112.00	0.10
18	600699	均胜电子	16,177.00	0.08
19	600795	国电电力	13,970.00	0.07
20	601186	中国铁建	11,759.00	0.06

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,368,320.00
卖出股票的收入（成交）总额	1,504,073.08

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费。

#### 7.5 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。

#### 7.6 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。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.8 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。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 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。

#### 7.10.2 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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 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。

#### 7.11.2 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。

#### 7.11.3 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。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	247.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	111.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	358.96
---	----	--------

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国工商银行—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	
		持有 份额	占总份额 比例	持有份 额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
350	23,121.0 7	5,328, 902.00	65.85%	2,763,4 74.00	34.15%	5,096,229 .00	62.98%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行—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“持有份额”和“占总份额比例”数据。

#### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	李彩雁	421,268.00	5.21%
2	赵淑文	263,368.00	3.25%
3	福建道冲投资管理有 限公司-道冲辛德勒 1 号私募基金	216,947.00	2.68%
4	周嘉	126,380.00	1.56%
5	韩啟成	80,000.00	0.99%

6	陈圣岐	58,977.00	0.73%
7	陈建锋	52,680.00	0.65%
8	沈群英	42,126.00	0.52%
9	闻培英	41,126.00	0.51%
10	王炜东	40,000.00	0.49%
-	中国工商银行—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	5,096,229.00	62.98%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 4 月 22 日）基金份额总额	652,308,409
本报告期期初基金份额总额	8,392,376
本报告期基金总申购份额	900,000
减：本报告期基金总赎回份额	1,200,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,092,376

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2019 年 3 月 29 日，海富通基金管理有限公司发布公告，因第五届董事会任期届满，经公司 2019 年第一次临时股东会审议通过，选举杨仓兵先生、吴淑琨先生、芮政先先生、任志强先生、Ligia TORRES (陶乐斯)女士、Alexandre WERNO (韦历山)先生、张馨先生、杨文斌 (Philip YOUNG Wen Binn)先生、刘正东先生、陈静女士担任公司第六届董事会董事，其中张馨先生、杨文斌 (Philip YOUNG Wen Binn)先生、刘正东先生、陈静女士为独立董事。原第五届董事会成员张文伟先生、杨明先生、杨国平先生、Marc Bayot (巴约特)先生、郑国汉 (Leonard K.CHENG)先生不再担任公司董事职务。

2、2019 年 3 月 29 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第一次会议审议通过，张文伟先生不再担任公司董事长职务，并决定由公司总经理任志强先生代为履行董事长职务，代为履行董事长职务的期限不超过 90 日。

3、2019 年 4 月 29 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第一次会议审议通过，聘请杨仓兵先生担任公司董事长职务。自杨仓兵先生任董事长职务之日起，公司总经理任志强先生不再代行董事长职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	2,872,393.08	100.00%	2,674.99	100.00%	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

#### 2、（1）交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见。

#### （2）交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1>推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门会议讨论，形成重点评估的证券公司备选池，从中进行甄选。原则上，备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的 200%。

<2>甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见，并报公司总经理办公会议核准。

<3>核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的总经理办公会核准。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日
----	------	--------	-------

			期
1	海富通基金管理有限公司关于旗下基金 2018 年年度基金资产净值和基金份额净值公告	《中国证券报》	2019-01-01
2	海富通基金管理有限公司关于董事会成员换届变更的公告	《中国证券报》	2019-03-29
3	海富通基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《中国证券报》	2019-03-29
4	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《中国证券报》	2019-04-29
5	上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金场内交易价格波动提示公告	《中国证券报》	2019-05-18
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019-06-26
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加部分销售机构申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》	2019-06-28

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
ETF 基金联接基金	1	2019/1/1-2019/6/30	5,396,229.00	-	300,000.00	5,096,229.00	62.98%
<b>产品特有风险</b>							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；</p> <p>2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。</p> <p>3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							



#### 4、其他可能的风险。

##### 11.2 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 69 只公募基金。截至 2019 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 780 亿元人民币。

2004 年末开始，海富通及子公司为 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 2019 年 6 月 30 日，海外业务规模约 23 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 2019 年 6 月 30 日，海富通为近 80 家企业约 438 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 2019 年 6 月 30 日，海富通管理的特定客户资产管理业务规模约 388 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。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。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有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 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首批基本养老保险基金投资管理人。

2018 年 3 月，国内权威财经媒体《证券时报》授予海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金为第十三届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金。2019 年 3 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金再度被权威媒体《证券时报》授予第十四届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金和 2018 年度绝对收益明星基金。2019 年 4 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威财经媒体《中国证券报》和《上海证券报》分别评选为第十六届中国基金业金牛奖——三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·灵活配置型基金奖（三年期）。同时，海富通基金管理有限公司荣获《上海证券报》第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·成长基金管理公司奖。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准设立上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金的文件
- (二) 上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (三) 上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- (四) 上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- (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

### 12.2 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。

### 12.3 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  
二〇一九年八月二十八日