上证可质押城投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
2014年12月11日

一、重要声明与提示

《上证可质押城投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。本基金托管人中国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2014年10月14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.htfund.com）上的《上证可质押城投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：城投ETF。
2、二级市场交易代码：511220。
3、基金申购赎回简称：城投申赎。
4、申购赎回代码：511221。
5、2014年12月9日基金份额总额：66,878,135份。
6、2014年12月9日基金份额净值：97.357元。
7、本次上市交易份额：66,878,135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：2014年12月16日。
10、基金管理人：海富通基金管理有限公司。
11、基金托管人：中国银行股份有限公司。
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”）：海通证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、中信证券（山东）有限责任公司、平安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司共16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：2014年9月9日经中国证券监督管理委员会证监许可【2014】932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2014年10月17日起至2014年11月7日止通过销售机构公开发售。其中，网下现金发售期间为2014年10月17日起至2014年11月7日，网上现金发售日期为2014年11月5日起至2014年11月7日，网下债券认购的发售期间为2014年10月17日起至2014年11月7日。
5、发售价格：1.00元人民币。
6、发售期限：网下现金发售16个工作日，网上现金发售3个工作日，网下债券认购16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、国泰君安证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、中信证券（山东）有限责任公司、平安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司和西南证券股份有限公司。
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
上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金自2014年10月17日起向社会公开募集，截至2014年11月7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6,687,472,613.00元（含所募集债券市值）。依照《上证可质押城投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340,917.00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2014年11月13日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户，所募集债券已于2014年11月12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，本基金募集期间含本息（含所募集债券市值）共募集6,687,813,530.00份基金份额，有效认购户数为3703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》、《上证可质押城投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2014年11月13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《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《上证可质押城投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2014年12月3日为上证可质押城投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2014年12月3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6,687,813,530份，折算前基金份额净值为0.994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66,878,135份，折算后基金份额净值为99.422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2014年12月4日进行了变更登记。基金份额持有人可以自2014年12月5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）基金上市交易
1、基金上市交易的核准机构和核准文号：2014【671】号。
2、上市交易日期：2014年12月16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：城投ETF。
5、二级市场交易代码：511220。
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：城投申赎。
7、申购赎回代码：511221。
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：海通证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（浙江）有限责任公司、中信证券（山东）有限责任公司、平安证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司共16家证券公司。
8、本次上市交易份额：66,878,135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2014年12月9日，本基金份额持有人户数为3,703户，平均每户持有的基金份额为18,061份。
（二）持有人结构
截至2014年12月9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66,813,575份，占基金总份额的99.90%；个人投资者持有的基金份额为64,560份，占基金总份额的0.10%。
（三）前十名基金份额持有人的情况：
截至2014年12月9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	国泰君安兴业定向	5,000,300	7.48
2	中江国际信托股份有限公司-光大银行融通宝五期单一资金信托	5,000,300	7.48
3	海通证券股份有限公司	4,729,451	7.07
4	中国东方资产管理公司	3,000,360	4.49
5	中江国际信托股份有限公司-金狮158号资金信托合同	2,800,000	4.19
6	国泰君安证券股份有限公司	2,000,120	2.99
7	东方证券股份有限公司	2,000,120	2.99
8	中国石油天然气集团公司企业年金计划-中国工商银行	2,000,120	2.99
9	中国人民财产保险股份有限公司-自有资金	2,000,120	2.99
10	信诚人寿保险有限公司-万能-三连宝投资组合债券、基金账户	1,185,000	1.77

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
总经理：田仁灿
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
工商登记注册的法人营业执照文号：310000400339452
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：
公司按照建立和完善公司治理结构的要求，设立董事会和监事会，并聘请了4名独立董事。为强化董事会的监督和指导功能，促进公司各项业务稳健发展，董事会设立了风险委员会、薪酬委员会、审计委员会三个专业委员会，其成员以独立董事为主。
董事会决定公司的战略规划，强化各项审计稽核监察职能，充分保障公司基金持有人的利益，为公司的健康发展提供最佳的资源支持，并且为保护基金持有人的利益提供最佳保障。董事会由九位董事组成，其中四名为独立董事。
监事会由四名监事组成，其中两名监事为公司职工代表，由公司职工民主选举和罢免。其余成员由股东会选举和罢免。监事会向股东会负责，并向股东会汇报工作情况。
公司实行董事会领导下的总经理负责制。总经理全面负责公司的经营管理。公司下设营销部、运营部、电子商务部、产品与创新部、机构业务部、国际业务部、渠道业务部、交易部、另类投资部、投资部、监察稽核部、风险管理部、法律部、人力资源部、战略发展部、财务部等部门。公司按照合理配置技能、有效激励和强调从业经验等原则，严把人员聘用关，公司员工覆盖基金运作的各个环节，能够保证本基金募集后顺利、规范运作。
3、人员情况：
截止2014年9月30日，公司正式员工188人，其中超过55%的员工具有硕士及以上学历。
4、信息披露负责人：奚万荣
电话：021-38650891
5、基金管理业务情况简介：
截至2014年9月30日，海富通基金管理有限公司旗下共管理29只公募基金，资产规模超过243亿元人民币。旗下管理的基金包括：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、海富通风格优势股票型证券投资基金、海富通精选武弓混合型证券投资基金、海富通中国海外精选股票型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长股票型证券投资基金、海富通中证100指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘股票型证券投资基金、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、海富通大中华精选股票型证券投资基金、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、海富通稳进增利分级债券型证券投资基金、海富通国策导向股票型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通现金管理货币市场基金、海富通养老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、海富通双利分级债券型证券投资基金、海富通内需热点股票型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通双福分级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。
6、本基金基金经理
陈轶平先生，博士，CFA。2009年1月至2009年8月任Mariner Investment Group LLC分析师，2009年10月至2011年9月任瑞银企业管理（上海）有限公司副董事，2011年10月加入海富通基金管理有限公司，任债券投资经理。2013年8月起任海富通货币基金经理，2014年8月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理，2014年11月起兼任海富通上证可质押城投债ETF基金经理。
（二）基金托管人
1、基本情况
名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人：田国立
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号
托管业务部总经理：李爱华
托管部门信息披露联系人：王永民
客服电话：95566
传真：（010）66594942
2、基金托管部门及主要人员情况
中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。
作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构银行间债券、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管产品体系。在国内，中国银行是首家开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。
3、证券投资基金托管情况
截至2014年9月30日，中国银行已托管293只证券投资基金，其中境内基金268只，QDII基金25只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列截至2013年12月31日，中国银行已托管247只证券投资基金，其中境内基金222只，QDII基金25只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。
（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：王开国
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：王开国
客户服务电话：021-95553或4008888001
联系人：李笑鸣
网址：www.htsec.com
（2）申银万国证券股份有限公司
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：储晓明
客户服务电话：95523，4008895523
联系人：黄莹
网址：www.sywg.com
（3）华泰证券股份有限公司
地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
客户服务电话：95597
联系人：肖亦玲
网址：www.htsc.com.cn
（4）东北证券股份有限公司
地址：吉林省长春市自由大路1138号
法定代表人：杨树财
客户服务电话：4006000686
联系人：潘锵
网址：www.nesc.cn
（5）招商证券股份有限公司
地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人：宫少林
客户服务电话：95565
联系人：林生迎
网址：www.newone.com.cn
（6）国信证券股份有限公司
地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层到26层
法定代表人：何如
客户服务电话：95536
联系人：齐晓燕
网址：www.guosen.com.cn
（7）平安证券有限责任公司
地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人：谢永林
客户服务电话：95511转8
联系人：郑舒丽
网址：stock.pingan.com
（8）光大证券股份有限公司
地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：郭新双
客户服务电话：95525
联系人：刘晨、李芳芳
网址：www.ebscn.com
（9）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：王东明
电话：95558
联系人：顾凌
网址：www.cs.ecitic.com
（10）中信证券（浙江）有限责任公司
地址：浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22、23层
法定代表人：沈强
客户服务电话：95548
联系人：姚铮
网址：www.bigsun.com.cn
（11）中信证券(山东)有限责任公司
地址：青岛市崂山区深圳路222号天泰金融广场A座20层
法定代表人：杨宝林
客户服务电话：95548
联系人：吴忠超
网址：www.zxwt.com.cn
（12）德邦证券有限责任公司
住所：上海市福山路500号城建国际中心26层
法定代表人：姚文平
客户服务电话：4008888128
联系人：罗芳
网址：www.tebon.com.cn
（13）华宝证券有限责任公司
地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
法定代表人：陈林
客户服务电话：4008209898
联系人：刘闻川
网址：www.cnhbstock.com
（14）信达证券股份有限公司
地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：张志刚
客户服务电话：400-800-8899
联系人：唐静
网址：www.cindasc.com
（15）长城证券有限责任公司
地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
客户服务电话：4006666888
联系人：高峰
网址：www.cgws.com
（16）东兴证券股份有限公司
地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层
法定代表人：魏庆华
客户服务电话：4008-888-993
联系人：黄英
网址：www.dxzq.net
（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：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
法定代表人：杨绍信
经办注册会计师：薛竞、叶尔甸
电话：(021) 23238888
传真：(021) 23238800
联系人：刘莉

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2014年12月9日的资产负债表如下：

资 产	本报告期末
	2014年12月9日
资 产：	
银行存款	99,043,767.94
结算备付金	125,952,017.76
存出保证金	1,692,078.64
交易性金融资产	5,406,812,044.60
其中：股票投资	-
债券投资	5,406,812,044.60
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	148,500,000.00
应收证券清算款	501,566,463.21
应收利息	227,963,853.57
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	340,917.00
资产总计	6,511,871,142.72
负债和所有者权益	本报告期末
	2014年12月9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	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	490,871.50
应付托管费	163,623.84
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	136,484.55
负债合计	790,979.89
所有者权益：	
实收基金	6,687,813,530.00
未分配利润	-176,733,367.17
所有者权益合计	6,511,080,162.83
负债和所有者权益总计	6,511,871,142.72

注：1、截至2014年12月9日，基金份额净值97.357元，基金份额总额66,878,135份。
2、本报告期自2014年11月13日起至2014年12月9日止。本基金合同于2014年11月13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2014 年12月9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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	5,406,812,044.60	83.03
	其中：债券	5,406,812,044.60	83.03
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	148,500,000.00	2.28
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	224,995,785.70	3.46
6	其他资产	731,563,312.42	11.23
7	合计	6,511,871,142.72	100.00

（二）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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	5,406,812,044.60	83.04
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	5,406,812,044.60	83.04

（三）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	124108	12吴经开	1,100,000	112,662,000.00	1.73
2	124020	12辽城经	902,930	92,992,760.70	1.43
3	124187	13泰矿债	900,000	88,020,000.00	1.35
4	122719	12龙交投	800,000	87,512,000.00	1.34
5	124736	14柳龙投	800,000	87,088,000.00	1.34

（四）按行业分类的股票投资组合
截至2014 年12月9日，本基金未持有股票。
（五）投资组合报告附注
1、自基金合同生效日至2014 年12月9日，本基金前十名证券中没有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、处罚的证券。
2、本基金前十名债券中，没有投资于超出基金合同规定之外的债券。
3、其他资产构成如下：

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,692,078.64
2	应收证券清算款	501,566,463.21
3	应收股利	-
4	应收利息	227,963,853.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	340,917.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	731,563,312.42

4、权证投资情况
截至2014 年12月9日，本基金未持有权证；自基金合同生效日至2014 年12月9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2014 年12月9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2014 年12月9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2014年12月3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）中国证监会核准上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
（二）《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
（三）《上证可质押城投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）关于申请募集上证可质押城投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
2014年12月11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）依照《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，提名新的基金管理人；
（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对被投资公司行使股东权利，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）依法接受基金托管人的监督；
（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、赎回对价的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，编制申购赎回清单；
（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
（10）编制季度、半年度和年度基金报告；
（11）严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。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应予保密，不向他人泄露；
（13）按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；
（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托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；
（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
（18）组织并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；
（19）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并通知基金托管人；
（20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当到第三方处理有关基金事务的行为承担责任；
（23）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；
（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（26）建立并保存基金份额持有人名册；
（27）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。
（二） 基金托管人的权利与义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：
（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
（2）依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；
（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
（4）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券交易资金清算；
（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；
（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
（7）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，基金托管人的义务包括但不限于：
（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
（2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
（3）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，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
（4）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，不得委托第三人托管基金财产；
（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
（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；
（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）建立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》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：
（1）分享基金财产收益；
（2）参与分配清算后的剩余基金财产；
（3）依法申请转让或赎回其持有的基金份额；
（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
（7）监督基金管理人的投资运作；
（8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
（9）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，基金份额持有人的义务包括但不限于：
（1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说