上证10年期地方政府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:2018年11月17日
上市日期:2018年11月22日

一、重要声明与提示

《上证10年期地方政府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2018年6月25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10年期地方政府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:10年地债。
2、二级市场交易代码:511270。
3、基金申购赎回简称:10年地债。
4、申购赎回代码:511271。
5、2018年11月15日基金份额总额:60,457,471.00份。
6、2018年11月15日基金份额净值:101.7608元。
7、本次上市交易份额:60,457,471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:2018年11月22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”):安信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司和天风证券股份有限公司等7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:2018年1月19日经中国证券监督管理委员会证监许可【2018】167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2018年6月28日起至2018年9月27日止通过销售机构公开发售。其中,网下现金发售期间为2018年6月28日起至2018年9月27日,网上现金发售日期为2018年9月25日起至2018年9月27日,通过发售代理机构及基金管理人进行网下债券认购的发售期间为2018年6月28日起至2018年9月27日。
5、发售价格:1.00元人民币。
6、发售期限:网下现金发售65个工作日,网上现金发售3个工作日,网下债券认购65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的发售代理机构:海通证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、安信证券股份有限公司;
网下债券认购的发售代理机构:海通证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司;本基金网上现金发售代理机构为本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员。
(二)基金合同生效
上证10年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金自2018年6月28日起向社会公开募集,截至2018年9月27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6,045,517,146.00元(含所募集资金市值),募集债券已过户至基金托管人中国银行股份有限公司和本基金以联名方式开立在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的证券账户。依照《上证10年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,网下认购资金的银行利息230,000.00元折算成230,000.00份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2018年10月10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。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共募集6,045,747,146.00份基金份额,有效认购户数为3,734户。其中:本基金管理人固有资金认购本基金0.00份,占本基金总份额的比例为0.00%,本基金管理人的从业人员认购本基金22,000份,占本基金总份额的比例为0.00036%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《上证10年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金基金合同已符合生效条件。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2018年10月12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10年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《上证10年期地方政府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2018年10月24日为上证10年期地方政府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2018年10月24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6,045,747,146份,折算前基金份额净值为1.0072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60,457,471份,折算后基金份额净值为100.7183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2018年10月25日进行了变更登记。基金份额持有人可以自2018年10月26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:上海证券交易所自律监管决定书【2018】141号。
2、上市交易日期:2018年11月22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:10年地债。
5、二级市场交易代码:511270。
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:10年地债。
7、申购赎回代码:511271。
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:安信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司和天风证券股份有限公司等7家证券公司。

8、本次上市交易份额:60,457,471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2018年11月15日,本基金份额持有人户数为3,734户,平均每户持有的基金份额为16,191份。

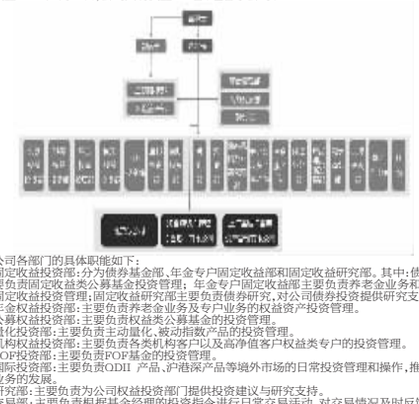
(二)持有人结构
截至2018年11月15日,本基金份额持有人结构如下:
机构投资者持有的基金份额为60,419,601份,占基金总份额99.94%;个人投资者持有的基金份额为37,870份,占基金总份额的0.06%。

(三)前十名基金份额持有人的情况:
截至2018年11月15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	中国银行股份有限公司	15,227,604	25.19%
2	中信证券股份有限公司	9,637,414	15.94%
3	中信建投证券股份有限公司	5,027,109	8.32%
4	海通证券股份有限公司	5,000,000	8.27%
5	国泰君安证券股份有限公司	4,818,224	7.97%
6	中国银河证券股份有限公司	3,000,720	4.96%
7	中国国际金融股份有限公司	2,878,718	4.76%
8	招商证券股份有限公司	2,000,480	3.31%
9	东方证券股份有限公司	1,911,935	3.16%
10	中国光大银行股份有限公司	1,825,857	3.02%

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
注册资本:15亿元人民币
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:91310000071093624 1R
信息披露负责人:奚万荣
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%、法国巴黎资产管理BE控股公司49%。
2、内部组织结构及职能:
截至2018年9月30日,公司共有员工270名(包含子公司)



公司各部门的具体职能如下:
固定收益投资部:分为债券基金部、年金专户固定收益部和固定收益研究部。其中:债券基金部主要负责固定收益类公募基金投资管理;年金专户固定收益部主要负责养老金业务和专户业务的固定收益投资管理;固定收益研究部主要负责债券研究,对公司债券投资提供研究支持。
年金权益投资部:主要负责养老金业务及专户业务的权益资产投资管理。
公募权益投资部:主要负责权益类公募基金的投资管理。
量化投资部:主要负责主动量化、被动指数产品的投资管理。
机构权益投资部:主要负责各类机构客户以及商净值客户权益类专户的投资管理。
FOF投资部:主要负责FOF基金的投资管理。
国际投资部:主要负责QDII产品、沪港深产品等境外市场的日常投资管理和操作,推动跨境投资业务的发展。
研究部:主要负责为公司权益投资部门提供投资建议与研究支持。
交易部:主要负责根据基金经理的投资指令进行日常交易活动,对交易情况及时反馈,并对投资指令进行监督。
养老金及资产管理部:主要负责养老金业务的客户拓展和日常维护。
金融机构及财富管理部:主要负责机构客户和高净值客户的公募基金业务和专户业务的拓展与维护工作。
投资服务部:主要负责公司各项业务的营销支持工作,并配合销售团队进行客户关系维护和产品研发。
渠道业务部:主要负责零售业务的拓展及营销工作。
电子商务部:主要负责公司在电商业务的开拓和作局。
产品与战略发展部:主要负责制定公司公募基金产品开发和创新研究以及制定公司的战略规划。
品牌建设部:主要负责公司品牌形象的建立和宣传推广。
运营部:分为信息技术部和基金会计部。其中:信息技术部主要负责公司信息系统的建设及维护;基金会计部主要负责公司基金资产清算,会计核算和法律登记等工作。
监察稽核部:主要负责公司的合规风险管理和内控规章制度的监督执行。
风险管理部:主要负责公司各项业务的风险管理工作。
综合管理部:主要负责公司股东会、董事会、监事会和公司经营管理层日常办公、行政事务。
财务部:主要负责公司财务管理、编制公司财务报告以及自有资产的投资管理工作。
人力资源部:主要负责公司人力资源的开发与管理,执行公司的薪酬福利计划。
北京分公司:主要负责建立并维护与政府及证券监管部门的有效沟通和分公司的行政管理。
睿诚海富通:主要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。
香港子公司:主要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61只公募基金。截至2018年9月30日,海富通管理的公募基金资产规模超过733.55亿元人民币。旗下正在运作的基金有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、海富通精选混合型证券投资基金、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、海富通大学城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、海富通精选混合型证券投资基金、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、海富通稳健添利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、海富通瑞裕一年定期开放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)、海富通量化前锋股票型证券投资基金、海富通瑞丰定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞利一年定期开放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)、海富通量化前锋股票型证券投资基金、海富通瑞丰定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞利一年定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞丰定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞丰定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞丰定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞丰定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞丰定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞丰定期开放债券型证券投资基金、上证10年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞丰定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞丰定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞丰定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞丰定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞丰定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞丰定期开放债券型