

# 海富通基金管理有限公司 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

(2018年第2号)

基金管理人：海富通基金管理有限公司  
基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示  
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”）于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。本基金的基金合同于2014年11月13日正式生效。本基金类型为交易型开放式。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人了解本基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面了解本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断基金的投资价值，自主、谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

本招募说明书所载内容截止日为2018年11月13日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年9月30日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

## 一、基金管理人

（一）基金管理人概况  
名称：海富通基金管理有限公司  
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  
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  
法定代表人：张文伟  
成立时间：2003年4月18日  
电话：021-38650999  
联系人：吴晨霞  
注册资本：1.5亿元人民币  
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%。

（二）主要人员情况  
张文伟先生，董事长，硕士，高级经济师。历任交通银行河南省分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长，海通证券办公室主任，海通证券投资银行总部副总经理，海富通基金管理有限公司董事、副总经理。2013年5月起任海富通基金管理有限公司董事长。

任志强先生，董事，总经理，硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理，华宝信托投资有限公司研究发展中心总经理兼投资管理部总经理，华宝信托投资有限公司总裁助理兼董事会秘书，华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。华宝兴业基金管理有限公司基金经理、投资总监、副总经理，华宝兴业资产管理（香港）有限公司董事长。2017年6月加入海富通基金管理有限公司，现任海富通基金管理有限公司董事、总经理。2018年3月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事长。

杨明先生，董事，管理学学士。历任中国人民银行新余支行科员，交通银行新余支行办公室科员、证券业务部负责人、证券业务部副主任、证券业务部主任，海通证券股份有限公司新余营业部总经理，海通证券股份有限公司江苏分公司筹备负责人、总经理、党委副书记，现任海通证券股份有限公司人力资源部总经理、党委组织部部长。

吴敏超先生，董事，管理学博士。历任南京大学副教授，海通证券股份有限公司研究所宏观研究部经理、所长助理、机构业务部副总经理、企业及私人客户服务部副主持、企业金融部总经理。现任海通证券股份有限公司战略发展部总经理。

Ligia Torres（陶乐斯）女士，董事，法国与墨西哥双重国籍，双硕士学位，曾任职于东方汇理银行、渣打银行和欧洲联合银行，1996年加入法国巴黎银行集团工作，2010年3月至2013年6月任法国巴黎银行资产管理部法国地区首席执行官，2010年10月至今任法国巴黎银行英国控股有限公司董事，2013年7月至今任法国巴黎资产管理公司亚太区CEO。

Alexandre Wemot（韦历山）先生，董事，法国籍，金融硕士学位。2007年9月至2013年4月任法国兴业银行全球市场部担任执行董事、中国区开发负责人职务；2013年6月至2017年11月先后任华宝兴业基金管理有限公司总经理高级顾问、常务副总经理职务；2017年11月至今任法国巴黎资产管理亚洲有限公司亚太区战略合作总监。

郑国汉先生，独立董事，经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济学副教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学商学院经济系教授及主任和商学院副院长、商学院院长兼经济系讲席教授，现任香港岭南大学校长。

Marc Bayot（巴约特）先生，独立董事，比利时籍，布鲁塞尔大学工商管理硕士，布鲁塞尔大学金融数学教授，EFAMA（欧洲金融和资产管理协会）和比利时基金会名誉主席，INVESTPROTECT（布鲁塞尔）董事总经理、Degroof资产管理（布鲁塞尔）独立董事，现任Pioneer投资公司（米兰、都柏林、卢森堡）独立董事、Fundconnect独立董事长和法国巴黎银行B Flexibile SICAV 独立董事。

杨国平先生，独立董事，硕士，高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、书记，上海市公用事业管理局党办主任，上海市出租汽车公司党委书记，现任大众通（集团）股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用事业（集团）股份有限公司董事长、上海交大昂立股份有限公司董事长。

张馨先生，独立董事，博士。历任厦门大学经济学院财金系教授及博士生导师、副院长兼系主任、厦门大学经济学院院长。2011年1月至今退休。

杨仓兵先生，监事长，管理学学士。历任安徽省农业科学院计划科副科长，安徽立康药业有限公司财务部干部、经理，海通证券股份有限公司计划财务部干部、计划资金部资金科科长、计划资金部副总经理、计划资金部副总经理，上海海振实业发展有限公司总经理，海通证券股份有限公司计划财务部副总经理。自2015年10月至今任海通证券股份有限公司资金管理部总经理。

Bruno Weil（魏海诺）先生，监事，法国籍，博士。历任巴黎银行东南亚负责人、亚洲金融机构项目副经理，法国巴黎银行跨国企业全球业务经理、亚洲金融机构投资业务部门负责人、零售银行中国区代表、南京银行副行长。现任法国巴黎银行集团（中国）副董事长。

俞涛先生，监事，博士，CFA。先后就职于上投摩根基金管理有限公司、摩根资产管理（英国）有限公司、曾任上投摩根基金管理有限公司业务发展部总监。2012年11月加入海富通基金管理有限公司，历任产品与创新发展部。2016年12月起任海富通基金管理有限公司总经理助理。

胡正万先生，监事，硕士。先后就职于成都机车车辆厂、四川省证券股份有限公司、富国基金管理有限公司，2003年4月加入海富通基金管理有限公司，历任基金会计、高级注册登记专员、注册登记负责人、基金运营部副经理。2015年7月起任海富通基金管理有限公司基金运营总监。

万乃荣先生，督察长，经济学硕士，中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省银行秀英分行会计主管，海通证券股份有限公司内部审计，2003年4月加入海富通基金管理有限公司，历任监事、监察稽核总监、总经理助理。2015年7月起，任海富通基金管理有限公司督察长。2015年7月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司监事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。

陶网维先生，副总经理，硕士。历任中国电子器材华东公司会计科长、上海中上实业发展公司主管会计、海通证券股份有限公司财务部副经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司，2003年4月至2006年4月任公司财务部负责人，2006年4月起任财务总监。2013年4月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。

何树方先生，副总经理，博士。历任山东济宁市财政贸易委员会副科长，魁北克蒙特利尔大学研究助理（兼职），魁北克公共退休基金管理公司分析师、基金经理助理，富国基金管理有限公司总经理助理，2011年6月加入海富通基金管理有限公司，任总经理助理。2014年11月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

陈殊先生，博士，CFA。历任Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业资产管理（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，历任投资经理助理、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。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理财理财债券基金经理。2014年11月起兼任海富通上证可质押城投债ETF基金经理。2015年12月起兼任海富通稳利增利债券基金经

理。2015年12月至2017年9月兼任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月起兼任海富通富祥混合基金经理。2016年8月起兼任海富通瑞丰一年定开债券基金经理。2016年8月至2017年11月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016年11月起兼任海富通美元债（ODI）基金经理。2017年1月起兼任海富通上证中期产业债ETF基金经理。2017年2月起兼任海富通富利债券基金经理。2017年3月至2018年6月兼任海富通富源债券基金经理。

2017年3月起兼任海富通富源纯债债券基金经理。2017年5月起兼任海富通富源混合基金经理。2017年7月至2018年12月兼任海富通欣悦混合基金经理。2017年7月起兼任海富通瑞福一年定开债券、海富通瑞丰一年定开债券基金经理。2018年4月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。2018年10月起兼任海富通上证10年期地方政府债ETF基金经理。2018年11月起兼任海富通弘丰定开债券基金经理。

陆从凡先生，硕士。曾任瑞银企业资产管理（上海）有限公司固定收益量分析师，2015年4月加入海富通基金管理有限公司，2015年6月起任海富通上证可质押城投债ETF基金经理助理。

投资决策委员会常设委员有：任志强，总经理；胡光涛，总经理助理；王智慧，总经理助理；孙海忠，总经理助理兼固定收益投资总监；杜晓海，量化投资部总监；王金祥，研究部总监；陈铁平，固定收益投资副总监；赵赫，年金权益投资总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则由基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况  
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：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清  
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号  
托管部门信息披露联系人：王为民  
客服电话：95566  
传真：（010）66594942

## 三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构  
1、申购赎回代理券商（简称“一级交易商”）  
（1）海通证券股份有限公司  
注册地址：上海市广东路689号海通证券大厦  
法定代表人：周杰  
办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦  
客户服务电话：95553或4008888001  
联系人：李美鸣  
网址：www.htsc.com.cn

（2）国信证券股份有限公司  
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十层  
法定代表人：何如  
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十层  
客户服务电话：95536  
联系人：周杨  
网址：www.guosen.com.cn

（3）光大证券股份有限公司  
注册地址：上海市静安区新闸路1508号  
法定代表人：魏健男  
办公地址：上海市静安区新闸路1508号  
客户服务电话：95625  
联系人：姚巍  
网址：www.ebscn.com

（4）申万宏源证券有限公司  
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层  
法定代表人：李梅  
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层  
客户服务电话：95523或4008885523  
联系人：陈敏  
网址：www.swhysc.com

（5）中信证券股份有限公司  
注册地址：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  
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦  
客户服务电话：95548  
联系人：王一通  
网址：www.csccit.com

（6）中信证券（山东）有限责任公司  
注册地址：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001  
法定代表人：姜晓飞  
办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层  
客户服务电话：95548  
联系人：刘晓明  
网址：www.zxwt.com.cn

（7）德邦证券股份有限公司  
注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼  
法定代表人：武晓春  
办公地址：上海市静安区福州路500号城建国际中心26楼  
客户服务电话：4008881283  
联系人：刘翔  
网址：www.tebon.com.cn

（8）平安证券股份有限公司  
注册地址：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：刘世安  
办公地址：深圳市福田区中心区金田路4036号荣超大厦16-20层  
客户服务电话：95511-8  
联系人：周驰  
网址：stock.pingan.com

（9）华宝证券有限责任公司  
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层  
法定代表人：陈林  
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼  
客户服务电话：4008209898  
联系人：刘闻川  
网址：www.cnhtstock.com

（10）东兴证券股份有限公司  
注册地址：北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）12、15层  
法定代表人：魏庆安  
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层  
客户服务电话：95309  
联系人：汤漫川  
网址：www.dxzq.net

（11）广东省深圳市福田中心区深南大道6008号特区报业大厦16-17层  
法定代表人：丁益  
办公地址：广东省深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层  
客户服务电话：4006666888  
联系人：金夏  
网址：www.cqws.com.cn

（12）信达证券股份有限公司  
注册地址：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  
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼  
客户服务电话：95321  
联系人：唐静  
网址：www.cindasc.com

（13）华泰证券股份有限公司  
注册地址：南京市江东中路228号  
法定代表人：周易  
办公地址：南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场  
客户服务电话：95587  
联系人：马艺卿  
网址：www.htsc.com.cn

（14）招商证券股份有限公司  
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38至45层  
法定代表人：董建  
办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层  
客户服务电话：95565  
联系人：林生迎  
网址：www.newone.com.cn

（15）东北证券股份有限公司  
注册地址：长春市生态大街6666号  
法定代表人：李福春  
办公地址：长春市生态大街6666号  
客户服务电话：95360  
联系人：安岩岩  
网址：www.nesc.cn

（16）国都证券股份有限公司  
注册地址：北京市东城区东直门内大街3号国华投资大厦9层10层  
办公地址：北京市东城区东直门内大街3号国华投资大厦9层10层  
客户服务电话：4008188118  
联系人：黄静  
网址：www.guodu.com

（17）国泰君安证券股份有限公司  
注册地址：上海市浦东新区商城路618号  
法定代表人：杨德红  
办公地址：上海市浦东新区世纪大道168号上海银行大厦29F  
客户服务电话：95521  
联系人：钟伟皓  
网址：www.gtja.com

（18）西藏东方财富证券股份有限公司  
注册地址：西藏拉萨市北京中路101号  
法定代表人：陈宏

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦  
客户服务电话：95357  
联系人：付仕  
网址：www.xzsec.com

（19）中邮证券股份有限公司  
注册地址：济南市市中区经七路86号  
法定代表人：李伟  
办公地址：山东省济南市市中区经七路86号  
客户服务电话：95638  
联系人：许曼华  
网址：www.zts.com.cn

（20）西部证券股份有限公司  
注册地址：陕西省西安市新城区东大街319号8幢10000室  
法定代表人：刘建武  
办公地址：陕西省西安市新城区东大街319号8幢10000室  
客户服务电话：95582  
联系人：梁承华  
网址：www.west95582.com

（21）天风证券股份有限公司  
注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼  
法定代表人：余磊  
办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼  
客户服务电话：93391或4008005000  
联系人：岑姝妹  
网址：www.tfzq.com

（22）中信建投证券股份有限公司  
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼  
法定代表人：王常青  
办公地址：北京市东城区朝内大街189号  
客户服务电话：95587或4008881018  
联系人：于梦圆  
网址：www.csc108.com

二、二级市场交易代理券商  
包括具有经纪业务资格和上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

二、登记结算机构  
名称：中国证券登记结算有限责任公司  
注册地址：北京市西城区太平桥大街17号  
法定代表人：周明  
联系人：刘永卫  
电话：（021）68872625  
传真：（021）68870311

三、出具法律意见书的律师事务所  
名称：上海市通力律师事务所  
住所：上海市银城中路68号 时代金融中心19楼  
办公地址：上海市银城中路68号 时代金融中心19楼  
负责人：吕卫锋  
电话：021-31358666  
传真：021-31358600  
联系人：孙睿  
联系电话：021-31358666  
经办律师：黎明、孙睿  
四、审计基金财产的会计师事务所  
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：薛竞、邵晓燕  
电话：(021) 23238888  
传真：(021) 23238800  
联系人：邵晓燕

四、基金的投资目标  
本基金的投资目标：上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的投资策略  
基金类型：交易型开放式

六、基金的投资目标  
本基金将紧密跟踪标的指数的走势，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.25%，年化跟踪误差率不超过3%。

七、投资方向  
本基金主要投资于标的指数的成份债券和备选成份券。

为了更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的其它债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，将其纳入投资范围。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数的成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产净值的80%，且不低于非现金基金资产的80%。

八、基金的投资策略  
（一）投资策略  
（二）资产配置策略  
本基金为指数基金，将采用分层抽样复制法对业绩比较基准进行跟踪。

分层抽样复制法指的是采用一定的抽样方法从构成指数的成份债券中抽取若干成份券构成用于复制指数跟踪组合的方法。采取该方法可以在控制跟踪误差的基础上，进一步减少了组合维护及再平衡所需的操作费用。

本基金将首先通过对标的指数中各成份债券的信用评级、历史流动性及收益率等进行分析，初步筛选流动性较好的成份券作为备选，其次将通过对标的指数的跟踪分析，剩余期限、信用评级、到期收益率以及债券发行主体所在区域等进行分层抽样，以构建组合与标的指数的在以上特征上尽可能相似，达到复制标的指数的指数、降低交易成本的目的。

由于采用抽样复制，本基金组合中的个股只数、权重和债券品种与标的指数可能存在差异。此外本基金在控制跟踪误差的前提下，可通过风险可控的积极管理获得超额收益，以弥补基金费用等管理成本，控制与标的指数的偏离度。

（二）替代性策略  
当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数的成份券及备选成份券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份券及备选成份券外寻找其他构建替代组合，对指数进行跟踪复制。

替代组合的构建将以债券流动性为约束条件，按照与被替代债券久期相近、信用评级相似、到期收益率及剩余期限基本匹配为主要原则，控制替代组合及被替代债券的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（三）衍生品投资策略  
未来，如法律法规或监管机构允许基金投资于其他与利率、标的指数的、指数化的成份债券或替代组合基金相关的其他非成份债券相关的各种衍生工具，如远期、掉期、期权、期货等，以及其他投资品种的，基金管理人将在履行适当程序后，可以将其他本基金的基金投资。本基金进行衍生品投资的目的使基金的投资组合更紧密地跟踪业绩比较基准，以便更好地实现基金的投资目标。

二、投资管理体制和程序  
1、决策依据  
有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产投资决策的依据。

2、投资管理体制  
本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，投资决策委员会负责制定有关基金重大调整的对策决策，其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理负责日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

3、投资程序  
研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估及组合维护等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

（1）研究支持：定量研究团队依托基金管理人整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果，开展指数跟踪、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策：投资决策委员会依据定量研究团队提供的研究报告，定期或遇重大事件时召开投资决策会议，决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理日常决策。

（3）组合构建：根据标的指数情况，结合研究支持，基金经理以抽样复制的指数成份债券及成份债券权重的方法构建组合，在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，降低买入成本、控制投资风险。

（4）交易执行：交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

（5）投资绩效评估：定量研究团队定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检视投资策略，进而调整投资组合。

（6）组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份债券基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变

化和实际需要对上述投资管理体制和程序做出调整，并在基金招募说明书中列示。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准即标的指数，上证可质押城投债指数。  
上证可质押城投债指数由中证指数有限公司编制及发布，指数样本由沪市剩余期限1年以上、债项评级为投资级以上、符合中国证券登记结算有限责任公司对可质押债券要求的城投类债券样本组成，为债券投资者提供新的投资标的。

如果中证指数有限公司变更或停止上证可质押城投债指数的编制及发布，或者上证可质押城投债指数被其他指数所替代，或者由于指数的编制方法等重大变更导致上证可质押城投债指数不宜继续作为本基金的标的指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合于投资的指数推出，基金管理人依据维护投资人合法权益的原则，经与托管人协商一致，通过适当的程序变更本基金的标的指数和业绩比较基准，并同时更换本基金的基金名称。若标的指数和业绩比较基准变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制方法变更、指数更名等），无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意变更后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。

## 十、基金的风险收益特征

本基金属于债券型股票基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、混合型基金、货币型基金。

本基金属于指数基金，采用分层抽样复制策略，跟踪上证可质押城投债指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。

## 十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年12月12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。

本投资组合报告所载数据截止至2018年9月30日（“报告期末”）。

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	—	—
其中：股票	—	—	—
2	固定收益投资	2,290,395,066.10	95.81
其中：债券	2,290,395,066.10	95.81	
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	19,961,134.93	0.83
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	6,475,000.51	0.27
7	其他资产	73,772,862.00	3.09
8	合计	2,390,594,062.54	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合  
2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合  
本基金本报告期末未持有股票。

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。

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

本基金本报告期末未持有股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	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	69,925,000.00	2.92
其中：政策性金融债	69,925,000.00	2.92	
4	企业债	2,230,572,066.10	93.00
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	2,290,395,066.10	95.92

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

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	124940	国债九零	613,380	38,040,104.20	1.59
2	124968	国债九零	577,300	35,301,152.00	1.50
3	124962	国债九零	549,840	34,161,659.20	1.43
4	124412	国债九零	531,120	32,679,813.60	1.37
5	124918	国债九零	517,500	32,002,200.00	1.34

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。

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。

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。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
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。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策  
根据本基金合同，本基金暂不投资股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

10.1 本期国债期货投资政策  
根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

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。

10.3 本期国债期货投资评价  
根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

11、投资组合报告附注  
11.1 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。

11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于占净值比例超过基金合同规定选股要求之外的股票。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	109,741.15
2	应收证券清算款	1,747,604.00
4	应收利息	71,915,616.85
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	预付款项	—