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

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】

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。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

本基金投资于证券市场,基金资产净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资人根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括但不限于:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险,本基金的特定风险等。本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金,属于中风险/收益的开放式基金。本基金为被动式投资的交易型开放式指数证券投资基金,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。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,全面认识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。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。

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新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,由投资人自行负责。

第一部分 绪言

《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》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)以及《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》(以下简称“基金合同”)编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

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“基金”或“本基金”)是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

第二部分 释义

在本招募说明书中,除非文义另有所指,下列词语或简称具有以下含义:

1、基金或本基金:指上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金
2、基金管理人:指海富通基金管理有限公司
3、基金托管人:指中国银行股份有限公司
4、基金合同:指《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》及对基金合同的任何有效修订和补充
5、托管协议:指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《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》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6、招募说明书或本招募说明书:指《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》及其定期的更新
7、基金份额发售公告:指《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》
8、上市交易公告书:指《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》
9、法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
10、《基金法》:指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订,自2013年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订
11、《销售办法》:指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日起实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时作出的修订
12、《信息披露办法》:指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
13、《运作办法》:指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
14、交易型开放式指数证券投资基金:指《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》定义的“交易型开放式指数基金”
15、联接基金:指将绝大多数基金财产投资于本基金,与本基金的投资目标类似,采用开放式运作方式的基金
16、中国证监会:指中国证券监督管理委员会
17、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
18、基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
19、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人
20、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
21、合格境外机构投资者:指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者
22、特定机构投资者:指根据上海证券交易所颁布的《特定机构投资者参与交易型开放式指数基金申购赎回业务指引》所定义机构投资者
23、投资人:指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称
24、基金份额持有人:指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
25、销售机构:指直销机构和代销机构
26、直销机构:指海富通基金管理有限公司
27、代销机构:指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议,代为办理基金销售业务的机构,包括发售代理机构和申购赎回代理券商
28、发售代理机构:指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,由基金管理人指定的、在募集期间代理本基金发售业务的机构
29、申购赎回代理券商:指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,由基金管理人指定的、在基金合同生效后代理办理本基金申购、赎回业务的证券公司,又称为代办证券公司
30、登记业务:指《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》定义的基金份额的登记、存管、结算及相关业务
31、登记机构:指中国证券登记结算有限责任公司
32、业务规则:指上海证券交易所发布实施的《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》及上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司发布的其他相关规则和规定
33、基金合同生效日:指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件,基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕,并获得中国证监会书面确认的日期
34、基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
35、基金募集期:指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间,最长不得超过三个月
36、存续期:指基金合同生效至终止之间的不定期期限
37、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
38、T日:指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日
39、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)
40、开放日:指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
41、开放时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
42、认购:指在基金募集期内,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
43、申购:指基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
44、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为赎回对价的行为
45、申购赎回清单:指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件
46、申购对价:指投资人申购基金份额时,按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价
47、赎回对价:指投资人赎回基金份额时,基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价
48、组合证券:指本基金标的指数所包含的全部或部分证券
49、标的指数:指中证指数有限公司编制并发布的上证可质押城投债指数及其未来可能发生的变更
50、现金替代:指申购、赎回过程中,投资人按基金合同和招募说明书的规定,用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金
51、现金差额:指最小申购、赎回单位的资产净值与按基金合同约定的估值方法计算的最小申购、赎回单位中的组合证券价值和现金替代之差;投资人申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购、赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算
52、最小申购、赎回单位:指本基金申购份额、赎回份额的最低数量,投资人申购、赎回的基金份额应为最小申购、赎回单位的整数倍
53、预估现金部分:指由基金管理人估计并在T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值,预估现金部分由申购赎回代理券商预先冻结
54、基金份额折算:指基金管理人根据基金合同的规定将基金份额持有人的基金份额进行变更登记的行为
55、元:指人民币元
56、基金收益:指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约
57、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
58、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值
59、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数
60、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
61、指定媒介:指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒介
62、不可抗力:指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

(下转A19版)

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

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
登记机构:	中国证券登记结算有限责任公司
基金销售机构:	销售机构为海富通基金管理有限公司的直销中心和销售机构(即符合《证券投资基金销售管理办法》和中国证监会规定的其它条件,取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议,代为办理基金销售业务的机构,包括发售代理机构和申购赎回代理券商)。 上市推荐人:海通证券股份有限公司 发售主协调人:海通证券股份有限公司 网下现金发售和网下债券发售直销机构:海富通基金管理有限公司 网下现金发售代理机构和网下债券发售代理机构: 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和中银万国证券股份有限公司。 网上现金发售代理机构包括具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司:爱建证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、首创证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、财达证券有限责任公司、恒泰长财证券有限责任公司、天源证券有限公司、财富里昂证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、万和证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、宏信证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、财通证券股份有限公司、宏源证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司、西藏同信证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、诚浩证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司、厦门证券有限公司、川财证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、湘财证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、新时代证券有限责任公司、大同证券经纪有限责任公司、华林证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、华龙证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、东方证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、华西证券有限责任公司、浙商证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、东兴证券股份有限公司、江海证券有限公司、中国民族证券有限责任公司、东莞证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、开源证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、联讯证券有限责任公司、中航证券有限公司、广发证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、中山证券有限责任公司、广州证券有限责任公司、南京证券股份有限公司、中天证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、中信万通证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、日信证券有限责任公司、中信证券(浙江)有限责任公司、国开证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、国盛证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、中邮证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、中原证券股份有限公司、爱建证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司。

重要提示

1.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”)的募集已获中国证监会证监许可【2014】932号文准予注册。中国证监会对本基金的注册并不代表中国证监会对本基金的风险和收益作出实质性判断、推荐或保证。

2.本基金是交易型开放式指数证券投资基金。

3.本基金管理人为海富通基金管理有限公司(以下简称“本公司”);基金托管人为中国银行股份有限公司;登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4.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。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购以及网下债券认购等三种方式认购本基金。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,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2014年10月17日起至2014年11月7日。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。

本基金的网上现金发售代理机构包括具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司:

序号	证券公司名称	序号	证券公司名称	序号	证券公司名称
1	爱建证券有限责任公司	34	国信证券股份有限公司	67	首创证券有限责任公司
2	安信证券股份有限公司	35	国元证券股份有限公司	68	太平洋证券股份有限公司
3	渤海证券股份有限公司	36	海通证券股份有限公司	69	天风证券股份有限公司
4	财达证券有限责任公司	37	恒泰长财证券有限责任公司	70	天源证券有限公司
5	财富里昂证券有限责任公司	38	恒泰证券股份有限公司	71	万和证券有限责任公司
6	财富证券有限责任公司	39	宏信证券有限责任公司	72	万联证券有限责任公司
7	财通证券股份有限公司	40	宏源证券股份有限公司	73	西部证券股份有限公司
8	长城证券有限责任公司	41	红塔证券股份有限公司	74	西藏同信证券有限责任公司
9	长江证券股份有限公司	42	华安证券有限责任公司	75	西南证券股份有限公司
10	诚浩证券有限责任公司	43	华宝证券有限责任公司	76	厦门证券有限公司
11	川财证券有限责任公司	44	华创证券有限责任公司	77	湘财证券股份有限公司
12	大通证券股份有限公司	45	华福证券有限责任公司	78	新时代证券有限责任公司
13	大同证券经纪有限责任公司	46	华林证券有限责任公司	79	信达证券股份有限公司
14	德邦证券有限责任公司	47	华龙证券有限责任公司	80	兴业证券股份有限公司
15	第一创业证券股份有限公司	48	华融证券股份有限公司	81	银泰证券有限责任公司
16	东北证券股份有限公司	49	华泰联合证券有限责任公司	82	英大证券有限责任公司
17	东方证券股份有限公司	50	华泰证券股份有限公司	83	招商证券股份有限公司
18	东海证券股份有限公司	51	华西证券有限责任公司	84	浙商证券股份有限公司
19	东吴证券股份有限公司	52	华鑫证券有限责任公司	85	中国国际金融有限公司
20	东兴证券股份有限公司	53	江海证券有限公司	86	中国民族证券有限责任公司
21	东莞证券有限责任公司	54	金元证券股份有限公司	87	中国银河证券股份有限公司
22	方正证券股份有限公司	55	开源证券有限责任公司	88	中国中投证券有限责任公司
23	光大证券股份有限公司	56	联讯证券有限责任公司	89	中航证券有限公司
24	广发证券股份有限公司	57	民生证券股份有限公司	90	中山证券有限责任公司
25	广州证券有限责任公司	58	南京证券股份有限公司	91	中天证券有限责任公司
26	国都证券有限责任公司	59	平安证券有限责任公司	92	中信建投证券股份有限公司
27	国海证券股份有限公司	60	齐鲁证券有限公司	93	中信万通证券有限责任公司
28	国金证券股份有限公司	61	日信证券有限责任公司	94	中信证券(浙江)有限责任公司
29	国开证券有限责任公司	62	瑞银证券有限责任公司	95	中信证券股份有限公司
30	国联证券股份有限公司	63	山西证券股份有限公司	96	中银国际证券有限责任公司
31	国盛证券有限责任公司	64	上海证券有限责任公司	97	中邮证券有限责任公司
32	国泰君安证券股份有限公司	65	申银万国证券股份有限公司	98	中原证券股份有限公司
33	爱建证券有限责任公司	66	世纪证券有限责任公司		

5.本基金管理人可办理网下现金发售和网下债券发售。

本基金的网下现金发售和网下债券发售的发售代理机构为: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和中银万国证券股份有限公司。

6.投资者认购本基金时需持有上海证券交易所A股账户(以下简称“A股账户”)或上海证券交易所证券投资基金账户(以下简称“上海证券交易所基金账户”)。

(1)如投资者需新开立证券账户,则应注意:

①上海证券交易所基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易,如投资者需要参与网下债券认购或基金份额的申购、赎回,则应开立A股账户。

②投资者开立证券账户,需在认购前持本人身份证到中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的开户代理机构办理上海A股账户或证券投资基金账户的开户手续。有关开设上海A股账户和证券投资基金账户的具体程序和办法,请到各开户网点详细咨询有关规定。

③开户当日无法办理指定交易,建议投资者在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。

(2)如投资者已开立证券账户,则应注意:

①如投资者未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司,需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

②当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购,建议投资者在进行认购前至少提前1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

(3)使用专用交易单元的机构投资人则无需办理指定交易。

7. 本基金认购费用或认购佣金不超过认购份额的0.4%。

8. 网上现金认购单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍,最高不得超过99,999,000份。投资者通过发售代理机构办理网下现金认购的,每笔认购份额须为1,000份或其整数倍;投资者通过基金管理人办理网下现金认购的,每笔认购份额须在10万份以上(含10万份),超过部分须为1万份的整数倍。投资者通过发售代理机构办理网下债券认购的,单只债券最低认购申报数为1手(人民币1000 元面值债券为1 手),超过1手的部分须为1手的整数倍;投资者通过基金管理人办理网下债券认购的,单只债券认购申报数必须为1手的整数倍,单笔认购份额须在50万份以上(含50万份)。上述认购方式投资者均可以多次认购,累计认购不设上限。

9. 网上现金认购申请提交后,投资者可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。网下现金认购、网下债券认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

10. 销售网点(指基金管理人和/或销售机构的销售网点)对申请的受理并不表示对该申请的成功确认,而仅代表销售网点确实接受了认购申请。申请的成功确认应以登记机构或基金管理人的确认登记为准。基金合同生效后,投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

11. 本公告仅对本基金基金份额发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读2014年10月14日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》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》(以下简称“招募说明书”)。

12. 本基金的基金合同、招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站(www.htfund.com),投资者亦可通过本公司网站下载基金申请表格和了解基金募集相关事宜。

13. 各发售代理机构的销售网点以及开户认购等事项的详细情况请向各发售代理机构咨询。

14. 未开设销售网点的地方的投资者,可拨打本公司的客户服务电话40088-40099咨询基金认购事宜。

15. 由于各基金销售机构系统及业务安排等原因,开放日的具体业务办理时间可能有所不同,投资者应参照各基金销售机构的具体规定。

16. 本公告可综合各种情况对募集安排做适当调整。

17. 基金募集期结束后,基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商(亦称“一级交易商”)名单,报上海证券交易所,经有关部门认可后,由上海证券交易所公告。本基金上市后,指定交易未在一级交易商的投资者只能进行本基金的二级市场买卖,如投资人需进行本基金的申购赎回交易,须指定交易或转指定交易到本基金的一级交易商。

18. 风险提示

证券投资基金(以下简称“基金”)是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资者购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险,既包括市场风险,也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型,投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期,也将承担不同程度的风险。一般来说,基金的收益预期越高,投资者承担的风险也越大。本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。本基金为指数型基金,采用分层抽样复制策略,紧密跟踪标的指数,具有和标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。

投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。本基金以1元初始面值开展基金募集,在市场波动等因素的影响下,基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于初始面值。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

投资者应当通过基金管理人或基金发售代理机构认购本基金,基金发售代理机构名单详见本基金招募说明书以及相关公告。

一、本次发售基本情况

1. 基金名称

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

场外简称:海富通上证可质押城投债ETF,

场内简称:城投ETF,

网上现金认购代码:511223,

二级市场交易代码:511220。

2. 基金类型

债券型证券投资基金

3. 基金运作方式

交易型开放式

4. 基金存续期限

不定期。

5. 基金份额初始面值

本基金的初始份额面值为人民币1.00元。

6. 投资目标

本基金将紧密跟踪标的指数,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%,年化跟踪误差不超过3%。

7. 投资范围和对象

本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。

为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他债券资产(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或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,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

在建仓完成后,本基金投资于标的指数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%。

8. 发售对象

中华人民共和国境内的个人投资人、机构投资人及合格境外机构投资者,以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者(法律、法规和有关规定禁止购买者除外)。

9. 销售机构

(1)上市推荐人

海通证券股份有限公司

(2)发售协调人

主协调人:

海通证券股份有限公司

(3)网下现金发售和网下债券发售直销机构

海富通基金管理有限公司

(4)网下现金发售代理机构和网下债券发售代理机构

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和中银万国证券股份有限公司。

(5)网上现金发售代理机构

网上现金发售代理机构包括具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司:

序号	证券公司名称	序号	证券公司名称	序号	证券公司名称
1	爱建证券有限责任公司	34	国信证券股份有限公司	67	首创证券有限责任公司
2	安信证券股份有限公司	35	国元证券股份有限公司	68	太平洋证券股份有限公司
3	渤海证券股份有限公司	36	海通证券股份有限公司	69	天风证券股份有限公司
4	财达证券有限责任公司	37	恒泰长财证券有限责任公司	70	天源证券有限公司
5	财富里昂证券有限责任公司	38	恒泰证券股份有限公司	71	万和证券有限责任公司
6	财富证券有限责任公司	39	宏信证券有限责任公司	72	万联证券有限责任公司
7	财通证券股份有限公司	40	宏源证券股份有限公司	73	西部证券股份有限公司
8	长城证券有限责任公司	41	红塔证券股份有限公司	74	西藏同信证券有限责任公司
9	长江证券股份有限公司	42	华安证券有限责任公司	75	西南证券股份有限公司
10	诚浩证券有限责任公司	43	华宝证券有限责任公司	76	厦门证券有限公司
11	川财证券有限责任公司	44	华创证券有限责任公司	77	湘财证券股份有限公司
12	大通证券股份有限公司	45	华福证券有限责任公司	78	新时代证券有限责任公司
13	大同证券经纪有限责任公司	46	华林证券有限责任公司	79	信达证券股份有限公司
14	德邦证券有限责任公司	47	华龙证券有限责任公司	80	兴业证券股份有限公司
15	第一创业证券股份有限公司	48	华融证券股份有限公司	81	银泰证券有限责任公司
16	东北证券股份有限公司	49	华泰联合证券有限责任公司	82	英大证券有限责任公司
17	东方证券股份有限公司	50	华泰证券股份有限公司	83	招商证券股份有限公司
18	东海证券股份有限公司	51	华西证券有限责任公司	84	浙商证券股份有限公司
19	东吴证券股份有限公司	52	华鑫证券有限责任公司	85	中国国际金融有限公司
20	东兴证券股份有限公司	53	江海证券有限公司	86	中国民族证券有限责任公司
21	东莞证券有限责任公司	54	金元证券股份有限公司	87	中国银河证券股份有限公司
22	方正证券股份有限公司	55	开源证券有限责任公司	88	中国中投证券有限责任公司
23	光大证券股份有限公司	56	联讯证券有限责任公司	89	中航证券有限公司
24	广发证券股份有限公司	57	民生证券股份有限公司	90	中山证券有限责任公司
25	广州证券有限责任公司	58	南京证券股份有限公司	91	中天证券有限责任公司
26	国都证券有限责任公司	59	平安证券有限责任公司	92	中信建投证券股份有限公司
27	国海证券股份有限公司	60	齐鲁证券有限公司	93	中信万通证券有限责任公司
28	国金证券股份有限公司	61	日信证券有限责任公司	94	中信证券(浙江)有限责任公司
29	国开证券有限责任公司	62	瑞银证券有限责任公司	95	中信证券股份有限公司
30	国联证券股份有限公司	63	山西证券股份有限公司	96	中银国际证券有限责任公司
31	国盛证券有限责任公司	64	上海证券有限责任公司	97	中邮证券有限责任公司
32	国泰君安证券股份有限公司	65	申银万国证券股份有限公司	98	中原证券股份有限公司
33	爱建证券有限责任公司	66	世纪证券有限责任公司		

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代理销售本基金,并及时公告。

10. 发售时间安排与基金合同生效

根据有关法律法规的规定,基金的募集期为自基金份额发售之日起不超过3个月。本基金募集期自2014年10月17日起至2014年11月7日,期间面向个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者同时发售。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。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2014年10月17日起至2014年11月7日。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间,并及时公告。募集结束,若符合基金合同规定的生效条件,基金管理人将办理基金备案手续,自中国证监会书面确认之日起,基金备案手续办理完毕,基金合同生效。

若3个月的法定募集期满,本基金的基金合同仍未达到基金合同规定的生效条件,本基金管理人将以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用,并将所募集的资金加计募集期间投资者通过现金认购方式购买本基金所产生的同期活期存款利息在募集期结束后30天内退还给基金认购人。对于基金募集期间网下债券认购所募集的债券,登记机构应予以解冻。

11. 基金认购方式与费率

(1)认购价格:本基金份额的认购价格为1.00元/份。

(2)认购费用:

认购费用由投资人承担,不高于0.4%,认购费率如下表所示:

图表1:认购费率

认购份额	认购费率
50万份以下	0.40%
50万份以上(含),100万份以下	0.20%
100万份以上(含)	每笔1000元

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下债券认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。

基金认购费用不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

(3)网上现金认购

1. 认购时间2014年11月5日起至2014年11月7日上午9:30-11:30和下午1:00-3:00。

2.认购限额:网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍,最高不得超过99,999,000份。投资人可以多次认购,累计认购份额不设上限。

3.认购金额的计算

本基金认购金额的计算如下:

认购佣金=认购价格×认购份额×佣金比率

(或若适用固定费用的,认购佣金=固定费用)

认购金额=认购价格×认购份额×(1+佣金比率)

(或若适用固定费用的,认购金额=认购价格 ×认购份额+固定费用)

认购佣金由发售代理机构收取,投资人需以现金方式交纳认购佣金。

例:某投资者到某发售代理机构网点认购10,000份本基金份额,假设该发售代理机构确认的佣金比率为0.4%,则需准备的资金金额计算如下:

认购佣金=10,000×1.00×0.4%=40元

认购金额=10,000×1.00×(1+0.4%)=10,040元

因投资者需准备10,040元资金,方可认购到10,000份本基金基金份额。

4.认购申请:投资人在认购本基金时,需按发售代理机构的规定,备足认购资金,办理认购手续。网上现金认购申请提交后,投资人可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。

5.清算交收:T日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请,由该发售代理机构冻结相应的认购资金,登记机构进行清算交收,并将有效认购数据发送发售协调人,发售协调人于网上现金认购结束后的第4 个工作日将实际到位的认购资金划往预先开设的基金募集专户。

6.认购确认:在募集期结束后3个工作日之后,投资人应通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

(4)网下现金认购

1.认购时间:2014年10月17日起至2014年11月7日,具体业务办理时间由基金管理人及其指定发售代理机构确定。

2.认购限额:网下现金认购以基金份额申请。投资人单笔认购须为1000 份或其整数倍。投资者通过基金管理人办理网下现金认购的,每笔认购份额须在10万份以上(含10万份),超过部分须为1万份的整数倍。投资人在募集期内可多次认购,认购期间单个投资人的累计认购规模没有限制。

3.认购金额的计算

(1)通过基金管理人进行网下现金认购的认购金额的计算:

认购费用=认购价格×认购份额×认购费率

(或若适用固定费用的,认购费用=固定费用)

认购金额=认购价格×认购份额×(1+认购费率)

(或若适用固定费用的,认购金额=认购价格 ×认购份额+固定费用)

净认购份额=认购份额+认购金额产生的利息/认购价格

认购费用由基金管理人收取,投资人需以现金方式交纳认购费用。

(2)通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算:同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

4.认购手续:投资人在认购本基金时,需按销售机构的规定,到销售网点办理相关认购手续,并备足认购资金。网下现金认购申请提交后在销售机构规定的时