

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金管理

[2015] 第二季度报告

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
报告送出日期：二〇一五年七月十八日

§ 1 基金提示

基金管理人的董事会及监事会对本基金所载资料不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏，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。

基金托管人对本报告书所载资料不存在虚假记载、误导陈述或重大遗漏，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。

本报告中所引用的数据未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：海富通上证可质押城投债ETF

场内简称：城投ETF

基金主代码：511220

交易代码：511220

基金运作方式：交易型开放式

基金合同生效日：2014年11月13日

报告期末基金份额总额：62,166,136.00份

基金份额净值：1.00元

基金总资产：81,628,149.09元

基金总负债：181,256,143.47元

基金份额净值比例：2.85%6

投资目标：本基金将紧密跟踪上证可质押城投债指数，力求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争基金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%。

投资策略：本基金将主要通过投资于上证可质押城投债指数成份股，采用行业轮动策略、定期调整策略、择时操作策略等方法，寻求在有效控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益。

本基金将不进行股票类资产的投资。

风险特征：本基金为交易型开放式指数基金，其特点是基金净值随标的指数波动，因此本基金的净值可能与同类基金相比波动性较大。

本基金将不进行股票类资产的投资。

本基金将不进行股票类资产的投资。