

## 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

# 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

基金管理人、基金托管人、基金销售机构应当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。  
基金管理人、基金托管人、基金销售机构应当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。  
基金管理人、基金托管人、基金销售机构应当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。

基金简称	海富通上证可质押城投债ETF
场内简称	城投ETF
基金代码	511220
交易代码	511220
基金运作方式	交易所开放式
基金合同生效日	2014年11月13日
报告期末基金份额总额	62,168.1350万份
投资目标	本基金跟踪标的指数的表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,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2.3%。
投资策略	本基金为指数基金,将采用自上而下和自下而上的资产配置策略进行跟踪。当由于市场流动性不足或因其他原因导致跟踪误差较大时,基金管理人可适度调整投资组合券久期限以满足投资需求,基金管理人可以在成份券及其备选成份券外寻找其他债券品种替代组合,对指数进行跟踪投资。
业绩比较基准	上证可质押城投债指数
风险收益特征	本基金属于债券基金,预期收益及预期风险水平低于股票型基金、混合型基金、高于货币型基金。本基金属于指数基金,采用分层复制策略,跟踪上证可质押城投债指数,其预期收益和预期风险与跟踪标的债券市场指数的风险收益特征相若。
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

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2015年4月1日至2015年6月30日)
1.本期已实现收益	81,628,349.99
2.本期利润	181,296,143.47
3.加权平均基金份额本期利润	2.856
4.期末基金资产净值	6,146,892,238.43
5.期末基金份额净值	98.875

注:(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平可能低于所列数据。  
(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 报告期末基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.88%	0.08%	0.06%	0.05%	1.98%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上证可质押城投债指数

报告期末基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:1、本基金合同于2014年11月13日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。  
2、本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月,建仓期结束本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四部分(二)投资范围、(四)投资策略中规定的各项比例。

### 4 管理人报告

#### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	本基金基金经理任期	证券从业年限	说明
陈晖平	本基金基金经理、海富通上证可质押城投债ETF基金经理	2014-11-13	6年	博士,持有基金从业资格(CFA),持有中国证券投资基金业协会基金从业资格,2009年1月至2009年8月任Munich Investment Group LLC分析师,2009年10月至2011年11月任德意志资产管理(上海)有限公司董事,2011年10月加入海富通基金管理有限公司,任债券基金经理,2013年5月起任海富通上证可质押城投债ETF基金经理,2014年8月起任海富通上证可质押城投债ETF基金经理。

注:1、对基金的聘任基金经理,其任期自报告期基金合同生效日,离任日期指公司做出决定之日;非聘任基金经理,其任期自离任日期起算。

2、证券从业年限的计算标准:自参加证券行业的相关工作开始计算。

3、投资管理人对报告期末基金运作期间守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人认真遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

报告期末,公司根据证监会2012年发布的《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》的具体要求,持续完善了公司投资交易业务授权、公平交易制度、制度和流程建设,场内上市股票、债券、货币、二级市场交易等投资管理活动,涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估和投资管理活动的全过程。同时,公司投资交易业务控制措施保证了各投资组合投资交易决策的独立性,确保其获得投资收益,投资交易记录和投资交易资产具有可追溯性。

4.4 公平交易专项说明

本报告期内,未发现基金管理人存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.5 公平交易专项说明

4.6 公平交易专项说明

4.7 公平交易专项说明

4.8 公平交易专项说明

4.9 公平交易专项说明

4.10 公平交易专项说明

4.11 公平交易专项说明

4.12 公平交易专项说明

4.13 公平交易专项说明

4.14 公平交易专项说明

4.15 公平交易专项说明

4.16 公平交易专项说明

4.17 公平交易专项说明

4.18 公平交易专项说明

4.19 公平交易专项说明

4.20 公平交易专项说明

4.21 公平交易专项说明

4.22 公平交易专项说明

4.23 公平交易专项说明

4.24 公平交易专项说明

4.25 公平交易专项说明

4.26 公平交易专项说明

4.27 公平交易专项说明

4.28 公平交易专项说明

4.29 公平交易专项说明

4.30 公平交易专项说明

4.31 公平交易专项说明

4.32 公平交易专项说明

4.33 公平交易专项说明

4.34 公平交易专项说明

4.35 公平交易专项说明

4.36 公平交易专项说明

4.37 公平交易专项说明

4.38 公平交易专项说明

4.39 公平交易专项说明

4.40 公平交易专项说明

4.41 公平交易专项说明

4.42 公平交易专项说明

4.43 公平交易专项说明

4.44 公平交易专项说明

4.45 公平交易专项说明

4.46 公平交易专项说明

4.47 公平交易专项说明

4.48 公平交易专项说明

4.49 公平交易专项说明

4.50 公平交易专项说明

4.51 公平交易专项说明

4.52 公平交易专项说明

4.53 公平交易专项说明

4.54 公平交易专项说明

4.55 公平交易专项说明

4.56 公平交易专项说明

4.57 公平交易专项说明

4.58 公平交易专项说明

4.59 公平交易专项说明

4.60 公平交易专项说明

4.61 公平交易专项说明

4.62 公平交易专项说明

4.63 公平交易专项说明

4.64 公平交易专项说明

4.65 公平交易专项说明

4.66 公平交易专项说明

4.67 公平交易专项说明

4.68 公平交易专项说明

4.69 公平交易专项说明

4.70 公平交易专项说明

4.71 公平交易专项说明

4.72 公平交易专项说明

4.73 公平交易专项说明

4.74 公平交易专项说明

4.75 公平交易专项说明

4.76 公平交易专项说明

4.77 公平交易专项说明

4.78 公平交易专项说明

4.79 公平交易专项说明

4.80 公平交易专项说明

4.81 公平交易专项说明

4.82 公平交易专项说明

4.83 公平交易专项说明

4.84 公平交易专项说明

4.85 公平交易专项说明

4.86 公平交易专项说明

4.87 公平交易专项说明

4.88 公平交易专项说明

4.89 公平交易专项说明

4.90 公平交易专项说明

4.91 公平交易专项说明

4.92 公平交易专项说明

4.93 公平交易专项说明

4.94 公平交易专项说明

4.95 公平交易专项说明

4.96 公平交易专项说明

4.97 公平交易专项说明

4.98 公平交易专项说明

4.99 公平交易专项说明

4.100 公平交易专项说明

4.101 公平交易专项说明

4.102 公平交易专项说明

4.103 公平交易专项说明

4.104 公平交易专项说明

4.105 公平交易专项说明

4.106 公平交易专项说明

4.107 公平交易专项说明

4.108 公平交易专项说明

4.109 公平交易专项说明

4.110 公平交易专项说明

4.111 公平交易专项说明

4.112 公平交易专项说明

4.113 公平交易专项说明

4.114 公平交易专项说明

4.115 公平交易专项说明

4.116 公平交易专项说明

4.117 公平交易专项说明

4.118 公平交易专项说明

4.119 公平交易专项说明

4.120 公平交易专项说明

4.121 公平交易专项说明

4.122 公平交易专项说明

4.123 公平交易专项说明

4.124 公平交易专项说明

4.125 公平交易专项说明

4.126 公平交易专项说明

4.127 公平交易专项说明

4.128 公平交易专项说明

4.129 公平交易专项说明

4.130 公平交易专项说明

4.131 公平交易专项说明

4.132 公平交易专项说明

4.133 公平交易专项说明

4.134 公平交易专项说明

4.135 公平交易专项说明

4.136 公平交易专项说明

4.137 公平交易专项说明

4.138 公平交易专项说明

4.139 公平交易专项说明

4.140 公平交易专项说明

4.141 公平交易专项说明

4.142 公平交易专项说明

4.143 公平交易专项说明

4.144 公平交易专项说明

4.145 公平交易专项说明

4.146 公平交易专项说明

4.147 公平交易专项说明

4.148 公平交易专项说明

4.149 公平交易专项说明

4.150 公平交易专项说明

4.151 公平交易专项说明

4.152 公平交易专项说明

4.153 公平交易专项说明

4.154 公平交易专项说明

4.155 公平交易专项说明

4.156 公平交易专项说明

4.157 公平交易专项说明

4.158 公平交易专项说明

4.159 公平交易专项说明

4.160 公平交易专项说明

4.161 公平交易专项说明

4.162 公平交易专项说明

4.163 公平交易专项说明

4.164 公平交易专项说明

4.165 公平交易专项说明

4.166 公平交易专项说明

4.167 公平交易专项说明

4.168 公平交易专项说明

4.169 公平交易专项说明

4.170 公平交易专项说明

4.171 公平交易专项说明

4.172 公平交易专项说明

4.173 公平交易专项说明

4.174 公平交易专项说明

4.175 公平交易专项说明

4.176 公平交易专项说明

4.177 公平交易专项说明

4.178 公平交易专项说明

4.179 公平交易专项说明

4.180 公平交易专项说明

4.181 公平交易专项说明

4.182 公平交易专项说明

4.183 公平交易专项说明

4.184 公平交易专项说明

4.185 公平交易专项说明

4.186 公平交易专项说明

4.187 公平交易专项说明

4.188 公平交易专项说明

4.189 公平交易专项说明

4.190 公平交易专项说明

4.191 公平交易专项说明

4.192 公平交易专项说明

4.193 公平交易专项说明

4.194 公平交易专项说明

4.195 公平交易专项说明

4.196 公平交易专项说明

4.197 公平交易专项说明

4.198 公平交易专项说明

4.199 公平交易专项说明

4.200 公平交易专项说明

4.201 公平交易专项说明

4.202 公平交易专项说明

4.203 公平交易专项说明

4.204 公平交易专项说明

4.205 公平交易专项说明

4.206 公平交易专项说明

4.207 公平交易专项说明

4.208 公平交易专项说明

4.209 公平交易专项说明</