

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:二〇一五年十月二十七日

§ 1 重要提示

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，并对其中内容的真实性、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2015年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

基金的过往绩效并不代表其未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9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	91,365,156,009份
投资目标	本基金紧密跟踪上证可质押城投债指数，力求在风险调整后的收益最大化、力争本基金的净值增长率与业绩比较基准的年均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过0.05%。
投资策略	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。当由于市场波动不足以形成法规规定的其他原因，导致标的指数成份股及备选成份股无法满足投资需求时，基金管理人可以成份股或备选成份股等进行跟踪复制。
业绩比较基准	上证可质押城投债指数，即要求兼顾幅度和期限的最小化，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准的年均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过0.05%。
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金。
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 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标		单位:人民币元
报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)	上期金额	
1.本期已实现收益		82,069,690.96
2.本期利润		181,845,777.41
3.加权平均基金份额本期利润		2.9409
4.期末基金资产净值		6,155,350,244.20
5.期末基金份额净值		100.318

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低于所列示的数字。

(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) 本基金已于2014年12月3日进行了基金份额折算，折算比例为0.01。

3.基金净值表现

3.2.1 本报告期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(%)	净值增长 率标准差 (%)	业绩比较基 准(%)	业绩比较基 准收益率准 差(%)	①-③	②-④
过去三个月	2.98%	0.00%	1.72%	0.04%	1.26%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金的份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比图

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年11月13日至2015年9月30日)

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

2015年9月30日

2015 第三季度报告

2015 第三季度报告