

信息披露 disclosure

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

2015年度报告摘要

需要保持密切关。 2. 本基金将严格遵守按照基金合同的要求,秉承指数化投资策略,跟踪组合与指数的拟合度。

4.6 管理人设有人工估值委员会,委员会成员具有3年以上的基金及相关行业工作经验、专业技能,并且能够在估值委员会相关工作中心提供估值服务。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。

估值委员会下设估值工作小组,估值工作小组充分听取相关机构的建议,并和基金托管人充分协商后,向估值委员会提交估值建议报告以及估值政策和程序评估报告,以便估值委员会最终决策。

估值政策经估值委员会审阅同意,并经本基金总办公会议批准后实施。

基金估值按照批准后的估值政策进行估值。

除了投资总监,其他基金基金经理不是估值委员会和估值工作小组的成员,不参与估值政策的制定。但是对于非活跃投资品种,基金经理可以向估值工作小组提供估值建议。

对于在交易所上市的投资,采用交易所发布的行情信息进行估值;对于固定收益品种,采用证券基金估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值标准。

4.7 管理人对报告期内基金净值变动情况的说明

根据基金合同的规定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每份基金份额每年收益分配次数最多40次,每次基金合同生效不满3个月可不对基金进行分配。

本基金报告期内进行了四次利润分配,分别为2015年3月10日,2015年6月4日,2015年9月18日和2015年11月30日本基金的可供分配利润为负数,四次分配计划于2015年3月21日,2015年6月18日,2015年9月11日和2015年12月14日完成利润分配登记,单位分红金额均为0.15元,合计利润分配金额377.193,810.00元,符合基金合同规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

5 受托人报告

5.1 报告期内本基金托管人履行受托职责情况

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“托管人”)在上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,未发现基金资产净值计算的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务报告、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分不在托管人职责范围内),投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

7 年度财务报表

会计主体:1. 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

	资产	2015年12月31日	2014年12月31日
资产:			
货币资金	24,626,347.93	66,394,883.69	
结算备付金	427,397.93	126,162.07	
存放同业款项	42,452.67	1,602,078.64	
交易性金融资产	5,907,946.10	5,899,217,423.00	
其中:股票投资	-	-	
债券投资	5,907,946.10	5,899,217,423.00	
资产减值准备	-	-	
其他资产	-	-	
负债和所有者权益			
负债:			
短期借款	-	-	
应付短期融资券	-	-	
应付票据	-	-	
应付账款	-	-	
应付利息	221,397,061.24	224,161,378.00	
应付股利	-	-	
其他负债	-	-	
所有者权益			
实收资本	6,266,765,818.08	6,517,347,573.97	
未分配利润	-	-	
所有者权益合计	6,266,765,818.08	6,517,347,573.97	

	负债和所有者权益	2015年12月31日	2014年12月31日
负债:			
短期借款	-	-	
应付短期融资券	-	-	
应付票据	-	-	
应付账款	-	-	
应付利息	221,397,061.24	224,161,378.00	
应付股利	-	-	
其他负债	-	-	
所有者权益			
实收资本	6,136,813,527.13	6,496,813,526.76	
未分配利润	124,516,312.36	160,534,124.88	
所有者权益合计	6,261,329,839.49	6,657,347,651.64	
负债和所有者权益合计	6,261,329,839.49	6,657,347,651.64	

注:1. 报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.02029元,基金份额总额61,366,135.00份。于2014年12月31日,基金份额净值0.7546元,基金份额总额866,788,135.00份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2015年度和2014年11月13日(基金合同生效日)至2014年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:1. 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	689,774,496.66	-169,474,024.80
利息收入	386,409,493.09	110,101,223.79
公允价值变动收益	1,157,269,836.58	769,263,441.61
其他收入	39,610,426.99	44,104,269.40
资产减值损失(减:计提)	-	-
二、费用	3,086,768.81	5,136,688.28
利息支出	-	-
其他费用	-28,137,146.81	-331,263.91
三、利润总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
所得税费用	-	-
四、净利润	686,667,727.85	-174,372,865.01
五、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
六、其他综合收益	-	-
七、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
八、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
九、其他综合收益	-	-
十、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
十一、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
十二、其他综合收益	-	-
十三、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
十四、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
十五、其他综合收益	-	-
十六、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
十七、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
十八、其他综合收益	-	-
十九、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
二十、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
二十一、其他综合收益	-	-
二十二、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
二十三、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
二十四、其他综合收益	-	-
二十五、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
二十六、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
二十七、其他综合收益	-	-
二十八、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
二十九、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
三十、其他综合收益	-	-
三十一、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
三十二、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
三十三、其他综合收益	-	-
三十四、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
三十五、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
三十六、其他综合收益	-	-
三十七、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
三十八、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
三十九、其他综合收益	-	-
四十、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
四十一、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
四十二、其他综合收益	-	-
四十三、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
四十四、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
四十五、其他综合收益	-	-
四十六、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
四十七、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
四十八、其他综合收益	-	-
四十九、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
五十、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
五十一、其他综合收益	-	-
五十二、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
五十三、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
五十四、其他综合收益	-	-
五十五、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
五十六、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
五十七、其他综合收益	-	-
五十八、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
五十九、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
六十、其他综合收益	-	-
六十一、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
六十二、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
六十三、其他综合收益	-	-
六十四、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
六十五、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
六十六、其他综合收益	-	-
六十七、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
六十八、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
六十九、其他综合收益	-	-
七十、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
七十一、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
七十二、其他综合收益	-	-
七十三、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
七十四、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
七十五、其他综合收益	-	-
七十六、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
七十七、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
七十八、其他综合收益	-	-
七十九、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
八十、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
八十一、其他综合收益	-	-
八十二、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
八十三、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
八十四、其他综合收益	-	-
八十五、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
八十六、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
八十七、其他综合收益	-	-
八十八、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
八十九、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
九十、其他综合收益	-	-
九十一、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
九十二、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
九十三、其他综合收益	-	-
九十四、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
九十五、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
九十六、其他综合收益	-	-
九十七、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01
九十八、每股收益		
基本每股收益	11.20	11.20
稀释每股收益	11.20	11.20
九十九、其他综合收益	-	-
一百、综合收益总额	686,667,727.85	-174,372,865.01

注:1. 对基金的首任基金管理人,其任期日期指基金合同生效日,离任日期指公司做出决定之日;非首任基金管理人,其任期日期指离任日期指公司做出决定之日。

2. 证券从购入到出售的计算标准:自参加证券行市的工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

4.2.1 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.2 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.3 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.4 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.5 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.6 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.7 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.8 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.9 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.10 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.11 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.12 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.13 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.14 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.15 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.16 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.17 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.18 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.19 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.20 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.21 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.22 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.23 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.24 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.25 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.26 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.27 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.28 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.29 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.30 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.31 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

4.2.32 基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管