

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

2017年度报告摘要

2017年 12月 31日

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:二〇一八年三月二十七日

§ 1 重要提示

1.1 管理人的董事会、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的法律责任。

1.2 本年度报告已经三分之二以上独立董事审阅，并由董事签字签发。

1.3 基金托管人中国银行股份有限公司根据本报告编制基金合同规定，于 2018 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内

容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对复核结果签发意见，但不保证基金一定盈利。

1.4 基金的过往业绩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基金的招募说明书及其更新。

1.5 本年度报告摘要经摘要自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

1.6 本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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1月13日

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

基金类别 指数型基金

基金合同的基金总金额 35,598,135.00 元

基金合同的存续期间 不定期

基金的存续期 2014年1月13日-不定期

基金的上市交易场所 上证证券交易所

上市日期 2014年12月16日

2.2 基本产品说明

注:1.对基金的基金经理,其任职日期指基金合同生效日,离任日期指公司做出决定之日;非任基金经理,其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日;非任基金经理,其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2.证券从年度年的计算标准;自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人报告报告期内基金的运作情况说明

本基金报告期内,本基金管理人认真遵照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则和谨慎的基本原则,在充分了解基金运作风险的基础上,努力为基金份额持有人的利益服务。

业绩比较基准 上证可质押城投债指数

本基金净值于基金净值,其期初收益及期间风险水平低于债券基金,属货币基金,高风险低收益。

本基金净值于基金净值,其期初收益及期间风险水平低于债券基金,属货币基金,高风险低收益。

本基金的过往业绩 2014年1月13日至2017年12月31日

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人

名称 海富通基金管理有限公司 中国银行股份有限公司

姓名 王军民

信息披露负责人 陈芳

电子邮箱 021-36950981

网址 www.hftfund.com

客户服务电话 40088-40099

传真 021-3303166

010-6694942

2.4 信息披露方式

基金年度报告以正式的管理人互联网网址

http://www.hftfund.com

基金年度报告备置地点

基金管理人办公地址

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 2017年 2016年 2015年

总资产 167,322,812.05 338,863,597.33 344,081,874.20

总负债 133,933,310.48 134,889,442.05 661,554,024.67

净资产 2,333.00 2,198.11 10,402.67

基金份额净值 2.44% 2.16% 11.04%

3.1.2 基本数据和指标 2017年 2016年

-5,448.00 -1,771.00 0.1270

基金份额净值 -3.362,092,145.68 6,024,171,820.03 6,280,329,829

基金份额净值 -94.552 96.229 102.029

注:1.本期已实现收益指基金本期营业收入、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。

2.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,计费用后实际收益水平要低于不计费用的水平。

3.期间费用分摊比例,采用期末净资产值计算,本期费用分摊比例为本期费用/期末净资产。

4.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 100:1。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

项目 份额增长率为正数的基金 份额增长率为负数的基金

份额净值增长率 0.29% -15.95%

收益增长率为正数的基金 收益增长率为负数的基金

0.04% 16.77%

①-③ 0.29% 0.04%

②-④ -15.95% 16.77%

注:1.本期已实现收益指基金本期营业收入、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。

2.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,计费用后实际收益水平要低于不计费用的水平。

3.期间费用分摊比例,采用期末净资产值计算,本期费用分摊比例为本期费用/期末净资产。

4.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 100:1。

3.2.2 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

项目 份额增长率为正数的基金 份额增长率为负数的基金

份额净值增长率 0.12% -35.7%

收益增长率为正数的基金 收益增长率为负数的基金

0.06% 16.92%

①-③ 0.12% -35.7%

②-④ 0.06% 16.92%

注:1.本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起 3 个月,建仓期结束时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)投资限制中规定的各项比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

(2014年 11月 13日至 2017年 12月 31日)

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

3.4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理的简介

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48号文批准,于2003年8月10日成立,注册资本人民币5亿元,公司总部设于上海,是中国证监会批准的第10家基金管理公司。

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48号文批准,于2003年8月10日成立,注册资本人民币