

上证城投债交易型开放式指数证券投资基金
(原上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金)

2019年第2季度报告

2019年6月30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：二〇一九年七月十七日

§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2019年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期内，原上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金转换为上证城投债交易型开放式指数证券投资基金。原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自2019年4月1日至2019年4月23日止，上证城投债交易型开放式指数证券投资基金本报告期自2019年4月24日至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 上证城投债交易型开放式指数证券投资基金

基金简称	海富通上证城投债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	2019年4月24日
报告期末基金份额总额	20,588,135.00份
投资目标	本基金将紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和

	跟踪误差的最小化，力争本基金的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。当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券及备选成份券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份券及备选成份券外寻找其他债券构建替代组合，对指数进行跟踪复制。
业绩比较基准	上证城投债指数收益率。
风险收益特征	<p>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、混合型基金，高于货币市场基金。</p> <p>本基金属于指数基金，采用分层抽样复制策略，跟踪上证城投债指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。</p>
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

2.2 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

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	22,088,135.00份
投资目标	本基金将紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争本基金的净值增长率与

	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。当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券及备选成份券无法满足投资需求时，基金管理人可以在成份券及备选成份券外寻找其他债券构建替代组合，对指数进行跟踪复制。
业绩比较基准	上证可质押城投债指数
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 本基金属于指数基金，采用分层抽样复制策略，跟踪上证可质押城投债指数，其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。
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

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2019年4月24日- 2019年6月30日)	报告期 (2019年4月1日- 2019年4月23日)
1.本期已实现收益	15,786,171.98	4,600,428.78
2.本期利润	20,580,724.66	-5,046,361.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.9500	-0.2241
4.期末基金资产净值	1,997,467,400.05	2,135,292,971.19

5.期末基金份额净值	97.020	96.671
------------	--------	--------

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要低于所列数字。

（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）自2019年4月24日起，由《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》修订而成的《上证城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效。

（4）原上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金已于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 上证城投债交易型开放式指数证券投资基金

（报告期：2019年4月24日-2019年6月30日）

3.2.1.1 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

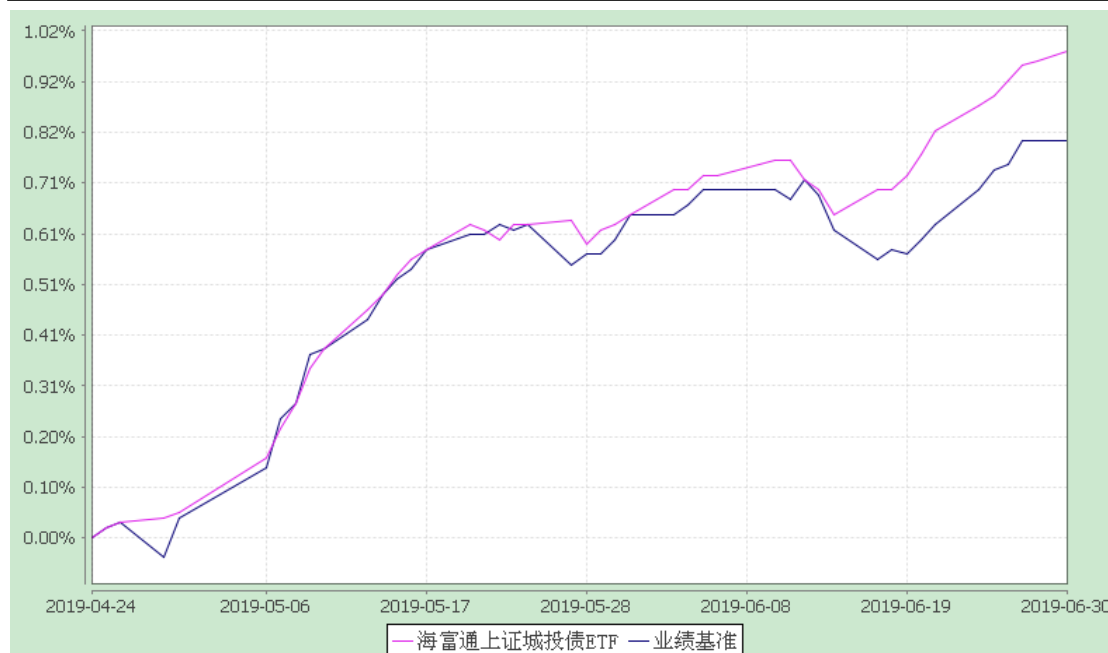
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2019.4.24-2019.6.30	0.98%	0.03%	0.81%	0.04%	0.17%	-0.01%

3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

上证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

(2019年4月24日-2019年6月30日)



注：1、本基金转型日期为2019年4月24日，截止报告期末，本基金转型未满一年。

2、按照本基金合同规定，本基金建仓期为自基金合同生效起3个月。截止本报告期末，本基金转型后，尚处于建仓期。

3.2.2 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

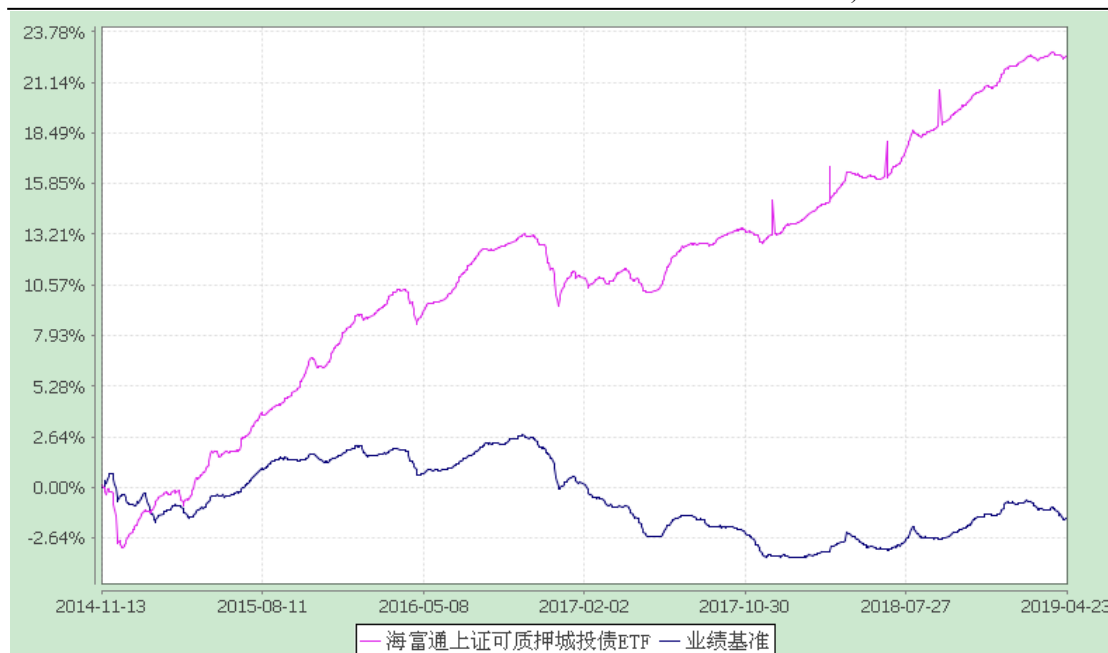
(报告期：2019年4月1日-2019年4月23日)

3.2.2.1 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
2019.4.1-2019.4.23	-0.23%	0.03%	-0.58%	0.05%	0.35%	-0.02%

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

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-2019年4月23日)



注：本基金合同于2014年11月13日生效，按照本基金合同规定，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。

§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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈轶平	本基金的基金经理；海富通货币基金经理；海富通季季增利	2014-11-13	-	10年	博士，CFA。持有基金从业人员资格证书。历任 Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事，2011年10月加入海富通基金管理有限公司，历任债券投资经理、基金经理、现金管理部副总监、债券基金部总监，现任固

	财债 券基 金经 理； 海富 通稳 固收 益债 券基 金经 理； 海富 通一 年定 开债 券基 金经 理； 海富 通富 祥混 合基 金经 理； 海富 通瑞 丰债 券基 金经 理； 海富 通美 元债 （QD II） 基金 经理； 海富 通上 证周 期产 业债 ETF 基金			定收益投资副总监。 2013年8月起任海富通 货币基金经理。 2014年8月起兼任海富 通季季增利理财债券基 金经理。2014年11月 起兼任海富通上证可质 押城投债ETF（现为海 富通上证城投债ETF） 基金经理。2015年 12月起兼任海富通稳固 收益债券基金经理。 2015年12月至 2017年9月兼任海富通 稳进增利债券（LOF） 基金经理。2016年4月 起兼任海富通一年定开 债券基金经理。 2016年7月起兼任海富 通富祥混合基金经理。 2016年8月起兼任海富 通瑞丰一年定开债券 （现为海富通瑞丰债券） 基金经理。2016年8月 至2017年11月兼任海 富通瑞益债券基金经理。 2016年11月起兼任海 富通美元债（QDII）基 金经理。2017年1月起 兼任海富通上证周期产 业债ETF基金经理。 2017年2月起兼任海富 通瑞利债券基金经理。 2017年3月至2018年 6月兼任海富通富源债 券基金经理。2017年 3月起兼任海富通瑞合 纯债基金经理。 2017年5月起兼任海富 通富睿混合基金经理。 2017年7月起兼任海富 通瑞福一年定开债券 （现为海富通瑞福债券） 、海富通瑞祥一年定开
--	--	--	--	---

	经理； 海富通瑞利债券基金经理； 海富通瑞合纯债基金经理； 海富通富睿混合基金经理； 海富通瑞福债券基金经理； 海富通瑞祥一年定开债券基金经理； 海富通恒丰定开债券基金经理； 海富通上证10年				债券基金经理。 2017年7月至2018年12月兼任海富通欣悦混合基金经理。2018年4月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。2018年10月起兼任海富通上证10年期地方政府债ETF基金经理。2018年11月起兼任海富通弘丰定开债券基金经理。2019年1月起兼任海富通上清所短融债券基金经理。
--	---	--	--	--	--

	期地 方政 府债 ETF 基金 经理; 海富 通弘 丰定 开债 券基 金经 理; 海富 通上 清所 短融 债券 基金 经理; 固定 收益 投资 副总 监。				
--	---	--	--	--	--

注：1、对基金的首任基金经理，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；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《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、勤勉尽职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

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司根据证监会 2011 年发布的《证券投资基金管理公司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流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内、境外上市股票、债券、基金的一级市场申购、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、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司建立了严格的投资交易行为监控制度，公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部门、监察稽核部和风险管理部组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证本报告期内公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度债券收益率呈现先上后下的走势。4月公布的一季度GDP同比增长6.4%，较去年四季度持平，增强了市场对上半年经济企稳的预期；同时基数效应叠加猪周期的启动，3月CPI跳升0.8个百分点至2.3%，引发市场对通胀的担忧。在经济企稳和通胀中枢上行的预期下，4月央行亦进入政策观察期，资金面边际收紧，带来4月利率的单边上行。而5月以来，中美贸易摩擦又起波澜，同时国内经济数据再度走弱，其中1-5月固定资产投资、社会消费品零售总额同比增长5.6%和8.1%，较去年同期下降0.5和1.4个百分点；此外，央行在实施定向降准的同时积极呵护资金面，短期内弱化了包商事件的冲击，隔夜资金利率一度跌破2%。由此，5月以来利率呈震荡下行态势。整体看，二季度1年期国开债收益率上行17BP，10年期国开债收益率上行3BP，期限利差有所收窄。信用债方面，二季度短期信用债收益率略有上行，中长期收益率小幅震荡，信用利差有所收窄。但值得注意的是5月底包商事件引发同业收缩及结构化发行风险，6月中低等级信用利差上行15BP左右，而高等级仅上行6BP，信用分化较为明显，中低等级净融资额占比较低，其信用利差绝对值处于历史较高水平。

本基金在本季度经过持有人大会，更改了基准指数。新指数主要增加了

2014年以后新发的AA+和AA城投企业债、以及2016年4月以后新发的AA+和AA城投平台交易所公司债。基金在基准指数更改后的3个月内属于建仓期，截止至季报披露，本基金基本完成建仓，后续仍有一定比例的持仓会继续调整。

作为指数基金，在操作上我们严格遵守基金合同，应用指数复制策略和数量化手段提高组合与指数的拟合度，降低跟踪误差。

未来，本基金将继续严格按照基金合同的要求，秉承指数化投资策略，提高组合与指数的拟合度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，原海富通上证可质押城投债ETF（2019.4.1-2019.4.23）基金份额净值增长率为-0.23%，同期业绩比较基准收益率为-0.58%；海富通上证城投债ETF（2019.4.24-2019.6.30）基金份额净值增长率为0.98%，同期业绩比较基准收益率为0.81%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 投资组合报告

5.1 上证城投债交易型开放式指数证券投资基金

（报告期：2019年4月24日-2019年6月30日）

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,132,249,277.80	96.90
	其中：债券	2,132,249,277.80	96.90
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	13,255,863.36	0.60
8	其他各项资产	55,010,770.08	2.50
9	合计	2,200,515,911.24	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	265,748.00	0.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,553,000.00	0.53
	其中：政策性金融债	10,553,000.00	0.53
4	企业债券	2,121,430,529.80	106.21
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
8	其他	-	-

9	合计	2,132,249,277.80	106.75
---	----	------------------	--------

5.1.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	124862	PR 台基投	431,070	26,584,086.90	1.33
2	127056	16 朝国资	266,930	26,559,535.00	1.33
3	143820	18 杭城 01	256,050	25,927,623.00	1.30
4	124805	PR 穗铁 02	346,930	25,787,306.90	1.29
5	124918	PR 沪南汇	405,750	24,957,682.50	1.25

5.1.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.1.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.1.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.1.9.2本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金暂不投资股指期货。

5.1.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.10.1本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

5.1.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.10.3本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.1.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.1.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	85,127.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	54,925,642.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,010,770.08

5.1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.2 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

(报告期：2019年4月1日-2019年4月23日)

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	2,007,647,022.20	93.52
	其中：债券	2,007,647,022.20	93.52
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	86,193,606.20	4.02
8	其他各项资产	52,925,580.62	2.47
9	合计	2,146,766,209.02	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	19,772,000.00	0.93
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,418,000.00	0.49
	其中：政策性金融债	10,418,000.00	0.49
4	企业债券	1,977,457,022.20	92.61
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,007,647,022.20	94.02

5.2.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	124840	PR 漳九龙	522,260	32,155,548.20	1.51
2	124862	PR 台基投	467,850	28,917,808.50	1.35
3	127056	16 朝国资	289,670	28,668,639.90	1.34
4	143820	18 杭城 01	277,860	27,994,395.00	1.31
5	124918	PR 沪南汇	440,300	27,153,301.00	1.27

5.2.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.2.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金暂不投资股指期货。

5.2.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.10.1本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

5.2.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.2.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.2.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	80,668.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	52,844,911.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,925,580.62

5.2.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

6.1 上证城投债交易型开放式指数证券投资基金

单位：份

基金转型日（2019-04-24）基金份额总额	22,088,135.00
基金转型日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金转型日起至报告期期末基金总赎回份额	1,500,000.00
基金转型日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	20,588,135.00

注：自2019年4月24日起，由《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》修订而成的《上证城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》生效。

6.2 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

单位：份

报告期期初基金份额总额	22,898,135.00
报告期基金总申购份额	-
减：报告期基金总赎回份额	810,000.00
报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	22,088,135.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 上证城投债交易型开放式指数证券投资基金

7.1.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

7.1.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

7.2.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 上证城投债交易型开放式指数证券投资基金

8.1.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

8.2.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.3 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于2003年4月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从2003年8月开始，海富通先后募集成立了69只公募基金。截至2019年6月30日，海富通管理的公募基金资产规模约780亿元人民币。

2004年末开始，海富通及子公司为QFII（合格境外机构投资者）及其他多个海内外投资组合担任投资咨询顾问，截至2019年6月30日，海外业务规模约23亿元人民币。

作为国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，截至2019年6月30日，海富通为近80家企业约438亿元的企业年金基金担任了投资管理人。作为首批特定客户资产管理业务资格的基金管理公司，截至2019年6月30日，海富通管理的特定客户资产管理业务规模约388亿元。2010年12月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2011年12月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012年2月，海富

通资产管理（香港）有限公司已募集发行了首只 RQFII 产品。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2018 年 3 月，国内权威财经媒体《证券时报》授予海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金为第十三届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金。2019 年 3 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金再度被权威媒体《证券时报》授予第十四届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金和 2018 年度绝对收益明星基金。2019 年 4 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威财经媒体《中国证券报》和《上海证券报》分别评选为第十六届中国基金业金牛奖——三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·灵活配置型基金奖（三年期）。同时，海富通基金管理有限公司荣获《上海证券报》第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·成长基金管理公司奖。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金变更注册的文件
- （二）上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- （三）上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- （四）上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- （五）中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- （六）报告期内上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9.2存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36—37 层本基金管理人办公地址。

9.3查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇一九年七月十七日