

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转  
型)  
2019年半年度报告  
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

送出日期：二〇一九年八月二十八日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 27 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及其更新。

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 1 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。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
§2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.1.1	上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金	5
2.1.2	上证城投债交易型开放式指数证券投资基金	5
2.2	基金产品说明	6
2.2.1	上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金	6
2.2.2	上证城投债交易型开放式指数证券投资基金	6
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.1.1	上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金	7
3.1.2	上证城投债交易型开放式指数证券投资基金	8
3.2	基金净值表现	9
§4	管理人报告	11
4.1	基金管理人及基金经理情况	11
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5	托管人报告	17
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6	半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1	上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金	18
6.1.1	资产负债表	18
6.1.2	利润表	19
6.1.3	所有者权益（基金净值）变动表	20
6.1.4	报表附注	21
6.2	上证城投债交易型开放式指数证券投资基金	39
6.2.1	资产负债表	39
6.2.2	利润表	40
6.2.3	所有者权益（基金净值）变动表	41
6.2.4	报表附注	42
§7	投资组合报告	58

7.1 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金 .....	58
7.1.1 期末基金资产组合情况 .....	58
7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	59
7.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	59
7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	59
7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	59
7.1.6 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 .....	60
7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	60
7.1.8 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贵金属投资明细 .....	60
7.1.9 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 .....	60
7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	60
7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
7.1.12 投资组合报告附注 .....	60
7.2 上证城投债交易型开放式指数证券投资基金 .....	61
7.2.1 期末基金资产组合情况 .....	61
7.2.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	62
7.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	62
7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	62
7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	62
7.2.6 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 .....	63
7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	63
7.2.8 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贵金属投资明细 .....	63
7.2.9 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 .....	63
7.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	63
7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	63
7.2.12 投资组合报告附注 .....	64
§8 基金份额持有人信息 .....	64
8.1 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金 .....	64
8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	64
8.1.2 期末上市基金前十名持有人 .....	65
8.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	65
8.1.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	65
8.2 上证城投债交易型开放式指数证券投资基金 .....	65
8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
8.2.2 期末上市基金前十名持有人 .....	66
8.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
8.2.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	66
§9 开放式基金份额变动 .....	67
9.1 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金 .....	67
9.2 上证城投债交易型开放式指数证券投资基金 .....	67
§10 重大事件揭示 .....	67
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	68
10.4 基金投资策略的改变 .....	68

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	68
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	68
10.8 其他重大事件 .....	70
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	71
§12 备查文件目录 .....	72
12.1 备查文件目录 .....	72
12.2 存放地点 .....	73
12.3 查阅方式 .....	73

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

基金名称	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
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
报告期末基金份额总额	22,088,135.00 份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.2 上证城投债交易型开放式指数证券投资基金

基金名称	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
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
报告期末基金份额总额	20,588,135.00 份
基金合同存续期	不定期

## 2.2 基金产品说明

### 2.2.1 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

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。

### 2.2.2 上证城投债交易型开放式指数证券投资基金

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	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。

## 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
信息披露 负责人	姓名	奚万荣	王永民
	联系电话	021-38650891	010-66594896
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942

注册地址	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	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址	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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	杨仓兵	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

#### 3.1.1 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期 2019年1月1日至2019年4月23日
本期已实现收益	23,766,672.34
本期利润	24,994,369.37
加权平均基金份额本期利润	1.0611
本期加权平均净值利润率	1.09%
本期基金份额净值增长率	1.07%

<b>3.1.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2019年4月23日)</b>
期末可供分配利润	-132,492,388.00
期末可供分配基金份额利润	-5.9984
期末基金资产净值	2,135,292,971.19
期末基金份额净值	96.671
<b>3.1.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2019年4月23日)</b>
基金份额累计净值增长率	22.46%

注：1、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。

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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。

### 3.1.2 上证城投债交易型开放式指数证券投资基金

金额单位：人民币元

<b>3.1.2.1 期间数据和指标</b>	<b>报告期 2019年4月24日至2019年6月30日</b>
本期已实现收益	15,786,171.98
本期利润	20,580,724.66
加权平均基金份额本期利润	0.9500
本期加权平均净值利润率	0.98%
本期基金份额净值增长率	0.98%
<b>3.1.2.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2019年6月30日)</b>
期末可供分配利润	-120,847,469.53
期末可供分配基金份额	-5.8698



额利润	
期末基金资产净值	1,997,467,400.05
期末基金份额净值	97.020
<b>3.1.2.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2019年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	0.98%

注：1、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。

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、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。

5、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

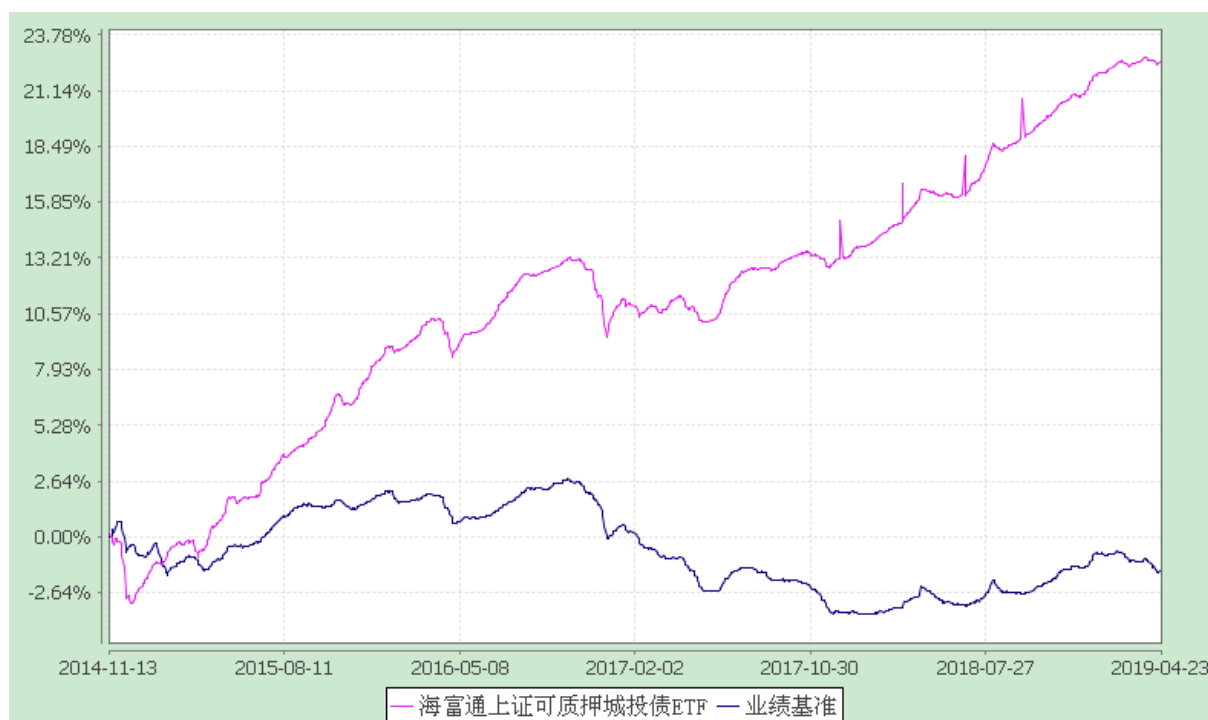
### 3.2.1 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

#### 3.2.1.1 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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%
2019.1.1-2019.4.23	1.07%	0.04%	-0.22%	0.05%	1.29%	-0.01%
2018.7.1-2019.4.23	5.25%	0.04%	1.63%	0.05%	3.62%	-0.01%
2016.7.1-2019.4.23	10.83%	0.06%	-2.77%	0.05%	13.60%	0.01%
2014.11.13-2019.4.23	22.46%	0.08%	-1.63%	0.06%	24.09%	0.02%

#### 3.2.1.2 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的历史走势对比图  
 (2014年11月13日至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。

### 3.2.2 上证城投债交易型开放式指数证券投资基金

#### 3.2.2.1 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

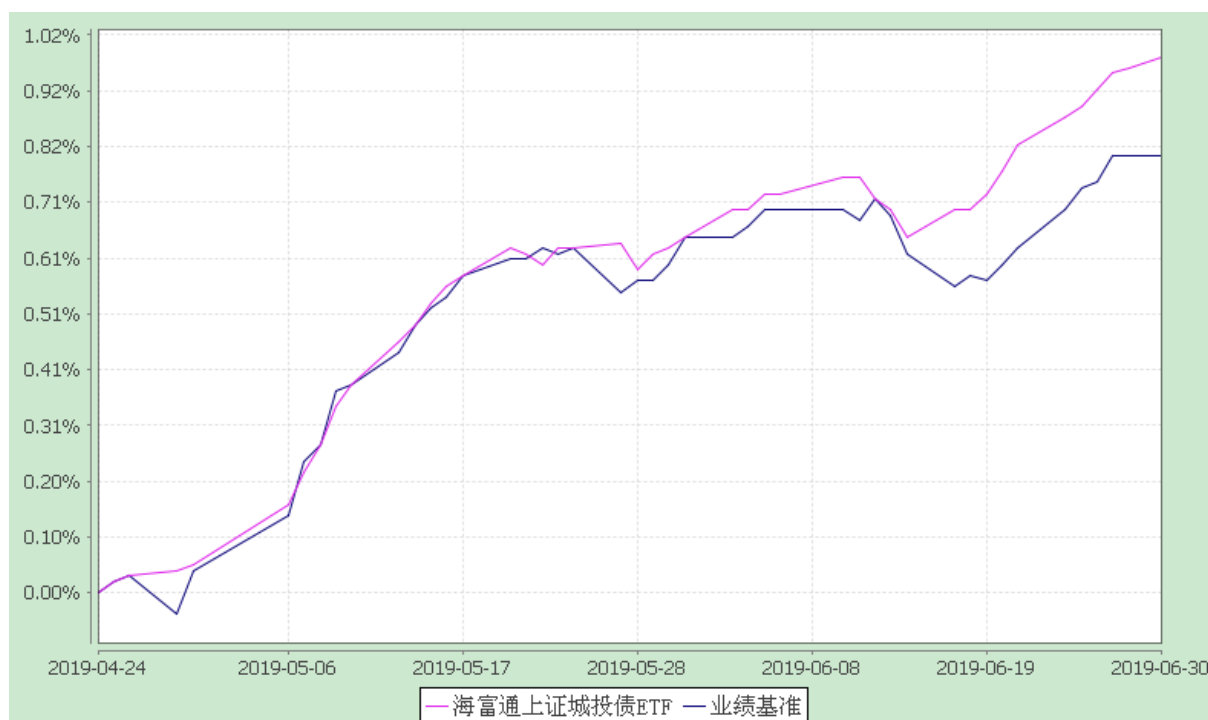
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.33%	0.03%	0.15%	0.03%	0.18%	0.00%
基金转型日 -2019.6.30	0.98%	0.03%	0.81%	0.04%	0.17%	-0.01%

#### 3.2.2.2 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的历史走势对比图

(2019年4月24日至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。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 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，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 61 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证

非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通双福债券型证券投资基金、海富通季季增利理财债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金 (LOF)、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通富睿混合型证券投资基金、海富通季季通利理财债券型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金 (FOF)、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)。

#### 4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 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; 海富通季季增利理财债券基金经理; 海富通稳固收益债券基金经理; 海富通一	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, 现任固定

	<p>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（QDII）基金经理；海富通上证周期产业债ETF基金经理；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。</p>				<p>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。</p>
<p>陆丛凡</p>	<p>本基金的基金经理助理；海富通聚利债券基金经理助理；海富通美元债（QDII）</p>	<p>2015-06-17</p>	<p>2019-07-03</p>	<p>7年</p>	<p>硕士，持有基金从业人员资格证书。曾任瑞银企业管理（上海）有限公司固定收益定量分析师，2015年4月加入海富通基金管理有限公司。2015年6月至2019年7月任海富通固定收益部基金经</p>

	基金经理助理；海富通上证周期产业债 ETF 基金经理助理；海富通富睿混合基金经理助理；海富通恒丰定开债券基金经理助理；海富通上证 10 年期地方政府债 ETF 的基金经理助理；海富通上清所短融债券的基金经理助理。				理助理。2019 年 7 月起任海富通上证城投债 ETF、海富通上证 10 年期地方政府债 ETF、海富通上清所短融债券的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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。

3、本公司于 2019 年 7 月 3 日发布公告，自 2019 年 7 月 3 日起，陆丛凡先生不再担任本基金的基金经理助理。

4、本公司于 2019 年 7 月 4 日发布公告，自 2019 年 7 月 3 日起，增聘陆丛凡先生担任本基金的基金经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，对公司旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合

互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

#### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年，债券收益率先经历了较长时间的震荡调整，而后又逐步下行，总体呈现区间震荡格局。年初，逆周期调节政策密集出台，中美贸易谈判进展顺利，天量信贷的投放和社融增速的反弹引发宽信用预期，带动股市单边走强、风险偏好修复；而一季度 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 涨幅跃升 0.8 个百分点至 2.3%，引发市场对通胀的担忧。在宽信用初见成效、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。由此，1 至 4 月利率呈震荡上行的态势。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，其中上半年固定资产投资、社会消费品零售总额累计同比增长 5.8% 和 8.4%，较去年同期下降 0.2 和 1 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 月以来利率呈下行态势。整体看，上半年 1 年期国开债收益率下行 2BP，10 年期国开债收益率下行 3BP，期限利差小幅收窄。信用债方面，上半年信用债收益率普遍下行，信用利差平均收窄 20BP 左右，其中短期限表现更佳。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，信用分化仍较明显，中低等级净融资额占比较低，其信用利差绝对值亦处于历史较高水平。

基金在二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，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。

##### 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 (2019.1.1-2019.4.23) 基金份额净值增长率为 1.07%，同期业绩比较基准收益率为 -0.22%；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 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计整体经济或承压，而通胀大概率先下后上。工业方面，整体需求回落或带来生产端疲软的表现；投资方面，房地产投资或平稳回落，制造业投资仍面临下行压力，而在政策支持下基建投资增速大概率继续温和回升，但难以完全对冲整体投资的下行；消费方面，居民收入增速放缓，消费或平稳走弱；出口方面，全球经济放缓风险加大，出口大概率难以改善。通胀方面，基数效应下 PPI 和 CPI 大概率先下后上，但在内外需疲软前提下通胀不存在显著风险。总体看下半年国内经济仍存下行压力，而四季度面临阶段性的通胀压力。货币政策方面，在国内经济未见企稳迹象和海外央行协同趋松的背景下，下半年央行或将延续稳健偏松，不排除会有降准和下调政策工具利率的操作。在上述判断下，我们认为下半年利率易下难上，可择机参与利率债交易，同时需关注未来政策逆周期调节的力度、通胀预期和资金面的变化以及中微观基本面的情况，谨防政策加码背景下四季度经济企稳和通胀回升的或有风险。信用债方面，信用风险仍处于高发期，银行打破刚兑对市场的预期影响仍在，负债端不够稳定的中小银行存在缩表可能，资产端或被动紧信用，市场潜在信用风险上升，信用利差存在走阔压力。

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。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理负责人、合规负责人、风险管理负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。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，估值工作小组对经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。



#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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为4次，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

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（2019.1.1-2019.4.23）进行过一次利润分配，以截止2019年3月4日本基金的可供分配利润为基准。本次分红于2019年3月18日完成权益登记，单位分红金额为0.75元，利润分配金额17,578,601.25元，符合基金合同规定。

上证城投债交易型开放式指数证券投资基金（2019.4.24-2019.6.30）进行过一次利润分配，以截止2019年6月4日的可供分配利润为基准。本次分红于2019年6月19日完成权益登记，单位分红金额为0.60元，利润分配金额12,784,881.00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 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在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）（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，本托管人根据《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，对基金资产净值的计算、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地复核，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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

6.1.1 资产负债表

会计主体：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：2019 年 4 月 23 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 4 月 23 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.1.4.7.1	85,036,795.71	1,073,372.92
结算备付金		1,156,810.49	1,364,467.89
存出保证金		80,668.68	76,066.43
交易性金融资产	6.1.4.7.2	2,007,647,022.20	2,338,144,615.10
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,007,647,022.20	2,338,144,615.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.1.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.1.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	3,661,368.84
应收利息	6.1.4.7.5	52,844,911.94	78,526,417.60
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.1.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>2,146,766,209.02</b>	<b>2,422,846,308.78</b>
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 4 月 23 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	86,800,000.00
应付证券清算款		10,146,044.65	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		411,780.81	598,837.47
应付托管费		137,260.26	199,612.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.1.4.7.7	2,850.00	3,997.50
应交税费		238,951.43	372,722.53
应付利息		-	-21,385.70
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.1.4.7.8	536,350.68	519,358.21
<b>负债合计</b>		<b>11,473,237.83</b>	<b>88,473,142.53</b>
<b>所有者权益：</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	6.1.4.7.9	2,208,813,517.10	2,421,813,518.37
未分配利润	6.1.4.7.10	-73,520,545.91	-87,440,352.12
<b>所有者权益合计</b>		<b>2,135,292,971.19</b>	<b>2,334,373,166.25</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>2,146,766,209.02</b>	<b>2,422,846,308.78</b>

注：1、报告截止日 2019 年 4 月 23 日（基金转型前日），基金份额净值 96.671 元，基金份额总额 22,088,135.00 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日（基金转型前日）。

### 6.1.2 利润表

会计主体：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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日-
<b>一、收入</b>		<b>28,751,350.55</b>	<b>87,615,255.45</b>
1.利息收入		39,556,333.47	92,648,736.24
其中：存款利息收入	6.1.4.7.11	64,898.33	112,180.56
债券利息收入		39,478,575.96	91,481,047.01
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		12,859.18	1,055,508.67
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-11,843,607.74	-64,471,816.00
其中：股票投资收益	6.1.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.1.4.7.13	-11,843,607.74	-64,471,816.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.1.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.1.4.7.15	-	-
股利收益	6.1.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.17	1,227,697.03	59,438,335.21
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.18	-189,072.21	-
<b>减：二、费用</b>		<b>3,756,981.18</b>	<b>7,012,675.10</b>
1. 管理人报酬		2,125,458.20	4,492,363.47
2. 托管费		708,486.05	1,497,454.46
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.1.4.7.19	4,118.59	14,179.33
5. 利息支出		517,104.61	25,875.11
其中：卖出回购金融资产支出		517,104.61	25,875.11
6. 税金及附加		127,174.60	326,916.89
7. 其他费用	6.1.4.7.20	274,639.13	655,885.84
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>24,994,369.37</b>	<b>80,602,580.35</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>24,994,369.37</b>	<b>80,602,580.35</b>

注：本财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日(基金转型前日)止期间。

### 6.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,421,813,518.37	-87,440,352.12	2,334,373,166.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,994,369.37	24,994,369.37

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-213,000,001.27	6,504,038.09	-206,495,963.18
其中: 1.基金申购款	6,000,000.12	-203,993.13	5,796,006.99
2.基金赎回款	-219,000,001.39	6,708,031.22	-212,291,970.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-17,578,601.25	-17,578,601.25
五、期末所有者权益(基金净值)	2,208,813,517.10	-73,520,545.91	2,135,292,971.19
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,555,813,528.16	-193,721,381.57	3,362,092,146.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	80,602,580.35	80,602,580.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-702,000,004.79	32,658,311.26	-669,341,693.53
其中: 1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-702,000,004.79	32,658,311.26	-669,341,693.53
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-89,844,405.00	-89,844,405.00
五、期末所有者权益(基金净值)	2,853,813,523.37	-170,304,894.96	2,683,508,628.41

注:本财务报表的实际编制期间为2019年1月1日至2019年4月23日(基金转型前日)止期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1.1至6.1.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:任志强,主管会计工作负责人:陶网雄,会计机构负责人:胡正万

## 6.1.4 报表附注

### 6.1.4.1 基金基本情况

上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]932号《关于准予上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币6,687,472,613.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第671号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于2014年11月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为6,687,813,530.00份基金份额,其中认购资金利息折合340,917.00份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《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》和《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,基金合同生效后,海富通基金管理有限公司可以对本基金进行基金份额折算与变更登记。根据2014年11月28日海富通基金管理有限公司《海富通基金管理有限公司关于上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》,本基金管理人于2014年12月3日对各基金份额持有人认购的基金份额进行折算。本基金折算前基金份额总额为6,687,813,530.00份,折算前基金份额净值为0.994元;根据本基金的基金份额折算方法,折算后基金份额总额为66,878,135.00份,折算后基金份额净值为99.422元。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证基字[2014]第671号文审核同意,本基金于2014年12月16日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数上证可质押城投债指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券,该部分资产的投资比例不低于基金资产净值的80%,且不低于非现金基金资产的80%。本基金还可以投资于国内依法发行上市的其他债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求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%。本基金的业绩比较基准:上证可质押城投债指数。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于2019年8月27日批准报出。

#### 6.1.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日(基金转型前日)止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 4 月 23 日(基金转型前日)的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 4 月 23 日(基金转型前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.1.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.1.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.1.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.1.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年4月23日	
	活期存款	85,036,795.71
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	85,036,795.71	

##### 6.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年4月23日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄	-	-	-



金合约				
债券	交易所市场	1,998,339,053.33	1,989,356,022.20	-8,983,031.13
	银行间市场	18,080,002.00	18,291,000.00	210,998.00
	合计	2,016,419,055.33	2,007,647,022.20	-8,772,033.13
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,016,419,055.33	2,007,647,022.20	-8,772,033.13

#### 6.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.1.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.1.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.1.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.1.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年4月23日
应收活期存款利息	26,896.56
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,305.62
应收债券利息	52,815,590.45
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	119.31
合计	52,844,911.94

#### 6.1.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

#### 6.1.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年4月23日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	2,850.00
合计	2,850.00

#### 6.1.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年4月23日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付指数使用费	141,697.19
预提费用	394,653.49
合计	536,350.68

#### 6.1.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年4月23日	
	基金份额	账面金额
上年度末	24,218,135.00	2,421,813,518.37
本期申购	60,000.00	6,000,000.12
本期赎回（以“-”号填列）	-2,190,000.00	-219,000,001.39
本期末	22,088,135.00	2,208,813,517.10

#### 6.1.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-151,426,878.20	63,986,526.08	-87,440,352.12
本期利润	23,766,672.34	1,227,697.03	24,994,369.37
本期基金份额交易产生的变动数	12,746,419.11	-6,242,381.02	6,504,038.09
其中：基金申购款	-372,778.79	168,785.66	-203,993.13
基金赎回款	13,119,197.90	-6,411,166.68	6,708,031.22

本期已分配利润	-17,578,601.25	-	-17,578,601.25
本期末	-132,492,388.00	58,971,842.09	-73,520,545.91

#### 6.1.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年4月23日
活期存款利息收入	51,632.36
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	12,813.63
其他	452.34
合计	64,898.33

#### 6.1.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.1.4.7.13 债券投资收益

##### 6.1.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年4月23日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-12,015,990.44
债券投资收益——赎回差价收入	172,382.70
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-11,843,607.74

##### 6.1.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年4月23日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	738,087,418.37
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	689,942,867.43
减：应收利息总额	60,160,541.38
买卖债券差价收入	-12,015,990.44

### 6.1.4.7.13 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年4月23日
赎回基金份额对价总额	212,291,970.17
减：现金支付赎回款总额	-368,782.89
减：赎回债券成本总额	205,575,651.70
减：赎回债券应收利息总额	6,912,718.66
赎回差价收入	172,382.70

### 6.1.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

### 6.1.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

### 6.1.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

### 6.1.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年4月23日
1.交易性金融资产	1,227,697.03
——股票投资	-
——债券投资	1,227,697.03
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,227,697.03

### 6.1.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019年1月1日至2019年4月23日
基金赎回费收入	-
替代损益	-189,072.21
合计	-189,072.21

#### 6.1.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年4月23日
交易所市场交易费用	436.09
银行间市场交易费用	3,682.50
合计	4,118.59

#### 6.1.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年4月23日
审计费	30,958.61
信息披露费	45,119.94
债券托管账户维护费	13,500.00
上市费	18,574.94
银行划款手续费	6,609.85
指数使用费	141,697.19
其他	18,178.60
合计	274,639.13

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季(自然季度)人民币25,000元。

#### 6.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.1.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.1.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.1.4.9 关联方关系

#### 6.1.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.1.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.1.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 6.1.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.1.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

#### 6.1.4.10.2 关联方报酬

##### 6.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年4月 23日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日-
当期发生的基金应支付的管理费	2,125,458.20	4,492,363.47
其中：支付销售机构的客户维护费	-	121,173.64

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%÷当年天数。

##### 6.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年4月23日	2018年1月1日至2018年6月30日-
当期发生的基金应支付的托管费	708,486.05	1,497,454.46

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% \div \text{当年天数}。$$

#### 6.1.4.10.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期						
2019年1月1日至2019年4月23日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	20,169,200.00	-	-	-	-
上年度可比期间						
2018年1月1日至2018年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

#### 6.1.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.1.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.1.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.1.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年4月23日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	85,036,795.71	51,632.36	13,201,043.78	95,660.73

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.1.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.1.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.1.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.1.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2019-03-18	2019-03-19	7.500	17,578,601.25	-	17,578,601.25	-
合计			7.500	17,578,601.25	-	17,578,601.25	-

#### 6.1.4.12 期末（2019年4月23日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.1.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.1.4.12.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
152129	19扬子01	2019-03-19	2019-06-04	新债未上市	100.00	99.10	100,000	10,000,000.00	9,910,000.00	-

##### 6.1.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.1.4.12.3.1 银行间市场债券正回购



本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 6.1.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 6.1.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.1.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，紧密跟踪上证可质押城投债指数，具有和标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中的中低风险品种。本基金以标的指数成份债券和备选成份债券为主要投资对象，采用优化抽样复制法，通过对各成份债券和备选成份债券历史数据和流动性分析，选取流动性较好的债券构建组合，达到复制标的指数、较低交易成本的目的。当在因特殊情况(如指数编制规则调整等)导致跟踪偏离度和跟踪误差超过风险控制目标，基金管理人将搭配使用其他合理方法采取合理措施，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和监察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

##### 6.1.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制

相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.1.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年4月23日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	19,772,000.00	-
合计	19,772,000.00	-

注：未评级部分为国债。

#### 6.1.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年4月23日	上年度末 2018年12月31日
AAA	917,382,008.60	832,762,891.00
AAA 以下	1,060,075,013.60	1,382,657,724.10
未评级	10,418,000.00	122,724,000.00
合计	1,987,875,022.20	2,338,144,615.10

注：未评级部分为政策性金融债。

#### 6.1.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2019 年 4 月 23 日, 本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.1.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理, 通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%, 且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%, 本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市, 其余亦可在银行间同业市场交易, 部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.1.4.12。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 4 月 23 日, 本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.46%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算, 确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末, 本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时, 本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度; 按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理, 以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外, 本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度: 根据质押品的资质确定质押率水平; 持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额; 并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时, 可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.1.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.1.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年4月 23日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	85,036,795.71	-	-	-	85,036,795.71
结算备付金	1,156,810.49	-	-	-	1,156,810.49
存出保证金	80,668.68	-	-	-	80,668.68
交易性金融资产	336,192,256.10	1,455,738,437.00	215,716,329.10	-	2,007,647,022.20
应收利息	-	-	-	52,844,911.94	52,844,911.94
资产总计	422,466,530.98	1,455,738,437.00	215,716,329.10	52,844,911.94	2,146,766,209.02
负债					
应付证券清算款	-	-	-	10,146,044.65	10,146,044.65
应付管理人报酬	-	-	-	411,780.81	411,780.81
应付托管费	-	-	-	137,260.26	137,260.26
应付交易费用	-	-	-	2,850.00	2,850.00
应交税费	-	-	-	238,951.43	238,951.43
其他负债	-	-	-	536,350.68	536,350.68
负债总计	-	-	-	11,473,237.83	11,473,237.83

利率敏感度缺口	422,466,530.98	1,455,738,437.00	215,716,329.10	41,371,674.11	2,135,292,971.19
上年度末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,073,372.92	-	-	-	1,073,372.92
结算备付金	1,364,467.89	-	-	-	1,364,467.89
存出保证金	76,066.43	-	-	-	76,066.43
交易性金融资产	230,274,957.10	1,814,564,193.70	293,305,464.30	-	2,338,144,615.10
应收证券清算款	-	-	-	3,661,368.84	3,661,368.84
应收利息	-	-	-	78,526,417.60	78,526,417.60
资产总计	232,788,864.34	1,814,564,193.70	293,305,464.30	82,187,786.44	2,422,846,308.78
负债					
卖出回购金融资产款	86,800,000.00	-	-	-	86,800,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	598,837.47	598,837.47
应付托管费	-	-	-	199,612.52	199,612.52
应付交易费用	-	-	-	3,997.50	3,997.50
应交税费	-	-	-	372,722.53	372,722.53
应付利息	-	-	-	-21,385.70	-21,385.70
其他负债	-	-	-	519,358.21	519,358.21
负债总计	86,800,000.00	-	-	1,673,142.53	88,473,142.53
利率敏感度缺口	145,988,864.34	1,814,564,193.70	293,305,464.30	80,514,643.91	2,334,373,166.25

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.1.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

	影响金额（单位：人民币万元）	
	本期末 2019 年 4 月 23 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
市场利率上升 25 个基点	减少约 904	减少约 1,054
市场利率下降 25 个基点	增加约 914	增加约 1,066

注：金额为约数，精确到万元。

#### 6.1.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.1.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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。本基金将首先通过对标的指数中各成份债券的信用评级、历史流动性及收益率等进行分析，初步选择流动性较好的成份券作为备选，其次将通过对标的指数按照久期、剩余期限、信用等级、到期收益率以及债券发行主体所在区域等进行分层抽样，以使构建组合与标的指数在以上特征上尽可能相似，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。由于采用抽样复制，本基金组合中的个券只数、权重和债券品种与标的指数可能存在差异。此外本基金在控制跟踪误差的前提下，可通过风险可控的积极管理获得超额收益，以弥补基金费用等管理成本，控制与标的指数的偏离度。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，投资于标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产净值的 80%，且不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 2019 年 4 月 23 日，本基金未持有交易性权益类投资(2018 年 12 月 31 日：同)，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.1.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## 6.2 上证城投债交易型开放式指数证券投资基金

### 6.2.1 资产负债表

会计主体：上证城投债交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
资产：		-
银行存款	6.2.4.7.1	11,412,896.90
结算备付金		1,842,966.46
存出保证金		85,127.35
交易性金融资产	6.2.4.7.2	2,132,249,277.80
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		2,132,249,277.80
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.2.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.2.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.2.4.7.5	54,925,642.73
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.2.4.7.6	-
<b>资产总计</b>		<b>2,200,515,911.24</b>
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
负债：		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		191,500,000.00
应付证券清算款		10,286,651.89
应付赎回款		-
应付管理人报酬		512,837.79
应付托管费		170,945.92

应付销售服务费		-
应付交易费用	6.2.4.7.7	3,650.00
应交税费		321,080.99
应付利息		2,760.25
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.2.4.7.8	250,584.35
<b>负债合计</b>		<b>203,048,511.19</b>
<b>所有者权益：</b>		<b>-</b>
实收基金	6.2.4.7.9	2,058,813,516.23
未分配利润	6.2.4.7.10	-61,346,116.18
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,997,467,400.05</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>2,200,515,911.24</b>

注：1、报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 97.020 元，基金份额总额 20,588,135.00 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2019 年 4 月 24 日（基金转型后首日）至 2019 年 6 月 30 日。

## 6.2.2 利润表

会计主体：上证城投债交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 4 月 24 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2019 年 4 月 24 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>22,763,678.23</b>
1.利息收入		21,628,593.14
其中：存款利息收入	<b>6.2.4.7.11</b>	25,725.30
债券利息收入		21,602,867.84
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		0.00
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,659,467.59
其中：股票投资收益	<b>6.2.4.7.12</b>	-
基金投资收益		-
债券投资收益	<b>6.2.4.7.13</b>	-3,659,467.59
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	<b>6.2.4.7.14</b>	-
衍生工具收益	<b>6.2.4.7.15</b>	-



股利收益	6.2.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.17	4,794,552.68
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.18	-
<b>减：二、费用</b>		<b>2,182,953.57</b>
1. 管理人报酬		1,177,002.50
2. 托管费		392,334.17
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.2.4.7.19	3,390.64
5. 利息支出		378,291.10
其中：卖出回购金融资产支出		378,291.10
6. 税金及附加		69,952.34
7. 其他费用	6.2.4.7.20	161,982.82
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>20,580,724.66</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>20,580,724.66</b>

注：本财务报表的实际编制期间为2019年4月24日(基金转型后首日)至2019年6月30日。

### 6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证城投债交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019年4月24日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月24日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,208,813,517.10	-73,520,545.91	2,135,292,971.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,580,724.66	20,580,724.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-150,000,000.87	4,378,586.07	-145,621,414.80
其中：1.基金申购款	-	0.00	-

2.基金赎回款	-150,000,000.87	4,378,586.07	-145,621,414.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-12,784,881.00	-12,784,881.00
五、期末所有者权益(基金净值)	2,058,813,516.23	-61,346,116.18	1,997,467,400.05

注：本财务报表的实际编制期间为 2019 年 4 月 24 日(基金转型后首日)至 2019 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.2.1 至 6.2.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：陶网雄，会计机构负责人：胡正万

## 6.2.4 报表附注

### 6.2.4.1 基金基本情况

上证城投债交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金转型而来。原基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]932 号《关于准予上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 6,687,472,613.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 671 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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》于 2014 年 11 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 6,687,813,530.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 340,917.00 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《关于修改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有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《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》、《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》分别修改为《上证城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《上证城投债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》，并据此编制《上证城投债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。上述法律文件已报中国证监会并已获得中国证监会《关于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批复》(证监许可[2018]963 号文)。本基金正式实

施转型日期为 2019 年 4 月 24 日，即《上证城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《上证城投债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》自 2019 年 4 月 24 日起生效，原《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》、《上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》自同日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数上证城投债指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券，该部分资产的投资比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金还可以投资于国内依法发行上市的其他债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求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%。本基金的业绩比较基准：上证城投债指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2019 年 8 月 27 日批准报出。

#### 6.2.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证城投债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 4 月 24 日(基金转型后首日)至 2019 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 4 月 24 日(基金转型后首日)至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.2.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.2.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.2.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.2.4.7重要财务报表项目的说明

### 6.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日	
	活期存款	11,412,896.90
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	11,412,896.90	

### 6.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	2,118,146,756.25	2,113,777,277.80	-4,369,478.45
	银行间市场	18,080,002.00	18,472,000.00	391,998.00
	合计	2,136,226,758.25	2,132,249,277.80	-3,977,480.45
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	2,136,226,758.25	2,132,249,277.80	-3,977,480.45	

### 6.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.2.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.2.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.2.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.2.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	2,125.26
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	746.37
应收债券利息	54,922,736.63
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	34.47
合计	54,925,642.73

#### 6.2.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

#### 6.2.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	3,650.00
合计	3,650.00

#### 6.2.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付指数使用费	105,918.90
预提费用	144,665.45
合计	250,584.35

#### 6.2.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年4月24日至2019年6月30日	
	基金份额	账面金额
本期初	22,088,135.00	2,208,813,517.10
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-1,500,000.00	-150,000,000.87
本期末	20,588,135.00	2,058,813,516.23

#### 6.2.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期初	-132,492,388.00	58,971,842.09	-73,520,545.91
本期利润	15,786,171.98	4,794,552.68	20,580,724.66
本期基金份额交易产生的变动数	8,643,627.49	-4,265,041.42	4,378,586.07
其中：基金申购款	-	-	0.00
基金赎回款	8,643,627.49	-4,265,041.42	4,378,586.07
本期已分配利润	-12,784,881.00	-	-12,784,881.00
本期末	-120,847,469.53	59,501,353.35	-61,346,116.18

注：本期期初：指城投转型日 2019 年 4 月 24 日前一自然日 2019 年 4 月 23 日。

#### 6.2.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月24日至2019年6月30日	
	活期存款利息收入	21,462.57
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	4,015.43	
其他	247.30	
合计	25,725.30	

#### 6.2.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.2.4.7.13 债券投资收益

#### 6.2.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月24日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,627,728.56
债券投资收益——赎回差价收入	-31,739.03
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-3,659,467.59

#### 6.2.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月24日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	241,167,117.83
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	225,429,718.35
减：应收利息总额	19,365,128.04
买卖债券差价收入	-3,627,728.56

#### 6.2.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月24日至2019年6月30日
赎回基金份额对价总额	145,621,414.80
减：现金支付赎回款总额	-306,045.53
减：赎回债券成本总额	142,236,295.23
减：赎回债券应收利息总额	3,722,904.13
赎回差价收入	-31,739.03

#### 6.2.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.2.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

#### 6.2.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。



#### 6.2.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年4月24日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	4,794,552.68
——股票投资	-
——债券投资	4,794,552.68
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,794,552.68

#### 6.2.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.2.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月24日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	340.64
银行间市场交易费用	3,050.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	3,390.64

#### 6.2.4.7.20其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月24日至2019年6月30日
审计费用	18,629.96
信息披露费	20,204.16
债券托管账户维护费	7,000.00
上市费	11,177.84
银行划款手续费	3,719.14
指数使用费	78,466.84
其他	22,784.88
合计	161,982.82

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季(自然季度)人民币25,000元。

#### 6.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.2.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.2.4.8.2资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.2.4.9 关联方关系

##### 6.2.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.2.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.2.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.2.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.2.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.2.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

#### 6.2.4.10.2 关联方报酬

##### 6.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月24日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,177,002.50
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%÷当年天数。

##### 6.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年4月24日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	392,334.17

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

#### 6.2.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.2.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.2.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.2.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.2.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年4月24日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	11,412,896.90	21,462.57

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.2.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.2.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.2.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.2.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2019-06-19	2019-06-20	6.000	12,784,881.00	-	12,784,881.00	-
合计			6.000	12,784,881.00	-	12,784,881.00	-

#### 6.2.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.2.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.2.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

### 6.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.2.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 6.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 191,500,000.00 元, 其中 30,000,000.00 元于 2019 年 7 月 1 日到期, 91,500,000.00 元于 2019 年 7 月 2 日到期, 70,000,000.00 元于 2019 年 7 月 5 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

### 6.2.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.2.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金, 紧密跟踪上证城投债指数, 具有和标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征, 属于证券投资基金中的中低风险品种。本基金以标的指数成份债券和备选成份债券为主要投资对象, 采用优化抽样复制法, 通过对各成份债券和备选成份债券历史数据和流动性分析, 选取流动性较好的债券构建组合, 达到复制标的指数、较低交易成本的目的。当在因特殊情况(如指数编制规则调整等)导致跟踪偏离度和跟踪误差超过风险控制目标, 基金管理人将搭配使用其他合理方法采取合理措施, 力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设, 在董事会下设立审计及风险管理委员会, 负责制定公司的风险管理政策, 审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等; 在管理层层面设立风险管理委员会, 负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和监察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发, 判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发, 根据本基金的投资目标, 结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型, 日常的量化报告, 确定风险损失的限度和相应置信程度, 及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估, 并通过相应决策, 将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.2.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任, 或者基金所投资证券之发行人出

现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.2.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日
AAA	1,032,228,220.30
AAA 以下	1,089,202,309.50
未评级	10,818,748.00
合计	2,132,249,277.80

注：未评级部分为国债、政策性金融债。

#### 6.2.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2019年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有191,500,000.00元将在2019年7月1日、2019年7月2日和2019年7月5日分别到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的全部金

融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.2.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.2.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 6 月 30 日,本基金未持有流动性受限的资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.2.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.2.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,412,896.90	-	-	-	11,412,896.90
结算备付金	1,842,966.46	-	-	-	1,842,966.46
存出保证金	85,127.35	-	-	-	85,127.35
交易性金融资产	311,506,735.80	1,677,777,673.20	142,964,868.80	-	2,132,249,277.80
应收利息	-	-	-	54,925,642.73	54,925,642.73
资产总计	324,847,726.51	1,677,777,673.20	142,964,868.80	54,925,642.73	2,200,515,911.24
负债					
卖出回购金融资产款	191,500,000.00	-	-	-	191,500,000.00
应付证券清算款	-	-	-	10,286,651.89	10,286,651.89
应付管理人报酬	-	-	-	512,837.79	512,837.79
应付托管费	-	-	-	170,945.92	170,945.92
应付交易费用	-	-	-	3,650.00	3,650.00
应交税费	-	-	-	321,080.99	321,080.99
应付利息	-	-	-	2,760.25	2,760.25
其他负债	-	-	-	250,584.35	250,584.35



负债总计	191,500,000.00	-	-	11,548,511.19	203,048,511.19
利率敏感度缺口	133,347,726.51	1,677,777,673.20	142,964,868.80	43,377,131.54	1,997,467,400.05

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.2.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）
		本期末 2019年6月30日
	市场利率上升25个基点	减少约1,010
	市场利率下降25个基点	增加约1,021

注：金额为约数，精确到万元。

#### 6.2.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.2.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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。本基金将首先通过对标的指数中各成份债券的信用评级、历史流动性及收益率等进行分析，初步选择流动性较好的成份券作为备选，其次将通过对标的指数按照久期、剩余期限、信用等级、到期收益率以及债券发行主体所在区域等进行分层抽样，以使构建组合与标的指数在以上特征上尽可能相似，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。由于采用抽样复制，本基金组合中的个券只数、权重和债券品种与标的指数可能存在差异。此外本基金在控制跟踪误差的前提下，可通过风险可控的积极管理获得超额收益，

以弥补基金费用等管理成本，控制与标的指数的偏离度。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，投资于标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于2019年6月30日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.2.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

(报告期：2019年1月1日-2019年4月23日)

#### 7.1.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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

## 7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.1.2.1 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。

### 7.1.2.2 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。

## 7.1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.1.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

### 7.1.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

### 7.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

## 7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,007,647,022.20	94.02

### 7.1.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	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

### 7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 7.1.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.1.9 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。

### 7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.1.10.1 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合约。

#### 7.1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

### 7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.1.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

#### 7.1.11.2 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。

#### 7.1.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

### 7.1.12 投资组合报告附注

7.1.12.1 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。

7.1.12.2 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。

### 7.1.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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

### 7.1.12.4 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。

### 7.1.12.5 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。

## 7.2 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)

### 7.2.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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

## 7.2.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.2.1 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。

### 7.2.2.2 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。

## 7.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.2.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

### 7.2.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

### 7.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

## 7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,132,249,277.80	106.75

#### 7.2.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	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

#### 7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.2.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.2.9 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。

#### 7.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 7.2.10.1 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合约。

##### 7.2.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同，本基金不参与股指期货交易。

#### 7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.2.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

##### 7.2.11.2 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。

### 7.2.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

### 7.2.12 投资组合报告附注

7.2.12.1 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。

7.2.12.2 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。

### 7.2.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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

### 7.2.12.4 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。

### 7.2.12.5 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。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

(报告期：2019年1月1日-2019年4月23日)

#### 8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者



		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
974	22,677.76	21,081,964.00	95.44%	1,006,171.00	4.56%

### 8.1.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	东方证券股份有限公司	2,000,120.00	9.06%
2	博时基金公司-农行-中国农业银行股份有限公司企业年金理事会	1,193,100.00	5.40%
3	中信证券股份有限公司	1,157,013.00	5.24%
4	中国建设银行股份有限公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公司	1,143,115.00	5.18%
5	中国石油天然气集团公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公司	1,072,100.00	4.85%
6	华夏基金-民生银行-中国民生银行股份有限公司	1,000,060.00	4.53%
7	东吴证券股份有限公司	999,990.00	4.53%
8	光大证券股份有限公司	897,701.00	4.06%
9	工银瑞信基金-兴业银行-工银瑞信-锦和6号资产管理计划	873,859.00	3.96%
10	工银瑞信基金-兴业银行-工银瑞信-信和6号资产管理计划	751,888.00	3.40%

### 8.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

### 8.1.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 8.2 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）

### 8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
960	21,445.97	19,573,737.00	95.07%	1,014,398.00	4.93%

### 8.2.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	东方证券股份有限公司	2,000,120.00	9.71%
2	中信证券股份有限公司	1,157,013.00	5.62%
3	中国建设银行股份有限公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公司	1,143,115.00	5.55%
4	博时基金公司-农行-中国农业银行股份有限公司企业年金理事会	1,112,744.00	5.40%
5	中国石油天然气集团公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公司	1,030,900.00	5.01%
6	华夏基金-民生银行-中国民生银行股份有限公司	1,000,060.00	4.86%
7	光大证券股份有限公司	897,701.00	4.36%
8	工银瑞信基金-兴业银行-工银瑞信-锦和6号资产管理计划	873,859.00	4.24%
9	工银瑞信基金-兴业银行-工银瑞信-信和6号资产管理计划	751,888.00	3.65%
10	东吴证券股份有限公司	549,228.00	2.67%

### 8.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

### 8.2.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

### 9.1 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

(报告期: 2019年1月1日-2019年4月23日)

单位: 份

基金合同生效日(2014年11月13日)基金份额总额	6,687,813,530.00
报告期期初基金份额总额	24,218,135.00
报告期基金总申购份额	60,000.00
减: 报告期基金总赎回份额	2,190,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	22,088,135.00

### 9.2 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)

单位: 份

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

注: 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期期间: 2019年1月1日至2019年4月23日。

2、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金报告期期间: 2019年4月24日至2019年6月30日。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金于2019年3月27日至2019年4月22日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会, 审议通过了《关于修改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有关事项的议案》, 决议自2019年4月24日起正式生效, 并已按规定向中国证券监督管理委员会备案。自2019年4月24日起, 本基金标的指数正式变更为上证城投债指数, 并将上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金更名为“上证城投债交易型开放式指数证券投资基金”, 并修改了基金合同中关于投资相关条款、业绩比较基准等内容。详情请参考本基金管理人发布的相关公告。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2019年3月29日，海富通基金管理有限公司发布公告，因第五届董事会任期届满，经公司2019年第一次临时股东会审议通过，选举杨仓兵先生、吴淑琨先生、芮政先先生、任志强先生、Ligia TORRES (陶乐斯)女士、Alexandre WERNO (韦历山)先生、张馨先生、杨文斌 (Philip YOUNG Wen Binn)先生、刘正东先生、陈静女士担任公司第六届董事会董事，其中张馨先生、杨文斌 (Philip YOUNG Wen Binn)先生、刘正东先生、陈静女士为独立董事。原第五届董事会成员张文伟先生、杨明先生、杨国平先生、Marc Bayot (巴约特)先生、郑国汉 (Leonard K.CHENG)先生不再担任公司董事职务。

2、2019年3月29日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第一次会议审议通过，张文伟先生不再担任公司董事长职务，并决定由公司总经理任志强先生代为履行董事长职务，代为履行董事长职务的期限不超过90日。

3、2019年4月29日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第一次会议审议通过，聘请杨仓兵先生担任公司董事长职务。自杨仓兵先生任董事长职务之日起，公司总经理任志强先生不再代行董事长职务。

2019年5月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

(报告期：2019年1月1日-2019年4月23日)

### 10.7.1.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内基金租用券商交易单元未发生变化。

#### 2、(1) 交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见。

#### (2) 交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门会议讨论，形成重点评估的证券公司备选池，从中进行甄选。原则上，备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的 200%。

<2> 甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见，并报公司总经理办公会议核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的总经理办公会议核准。

### 10.7.1.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	431,116,131.20	100.00%	1,279,300,000.00	100.00%	-	-

## 10.7.2 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)

### 10.7.2.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内基金租用券商交易单元未发生变化。

#### 2、(1) 交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见。

#### (2) 交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门会议讨论，形成重点评估的证券公司备选池，从中进行甄选。原则上，备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的 200%。

<2> 甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见，并报公司总经理办公会议核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的总经理办公会议核准。

#### 10.7.2.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	335,299,468.78	100.00%	1,684,000,000.00	100.00%	-	-

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于旗下基金 2018 年年度基金资产净值和基金份额净值公告	《证券时报》	2019-01-01
2	上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金第十六次分红公告	《证券时报》	2019-03-13
3	关于新增银河证券为上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、上证可质押城投债	《证券时报》	2019-03-22

	交易型开放式指数证券投资基金和上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告		
4	海富通基金管理有限公司关于以通讯方式召开上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	《证券时报》	2019-03-23
5	海富通基金管理有限公司关于以通讯方式召开上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	《证券时报》	2019-03-25
6	海富通基金管理有限公司关于以通讯方式召开上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	《证券时报》	2019-03-26
7	海富通基金管理有限公司关于董事会成员换届变更的公告	《证券时报》	2019-03-29
8	海富通基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《证券时报》	2019-03-29
9	海富通基金管理有限公司关于上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	《证券时报》	2019-04-25
10	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《证券时报》	2019-04-29

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

#### 11.1.1 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。

### 11.2 上证城投债交易型开放式指数证券投资基金

#### 11.2.1 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。

### 11.3 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。

## §12 备查文件目录

### 12.1 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

## 12.2 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。

## 12.3 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

二〇一九年八月二十八日