海富通上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2015年第2号）

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

重要提示

海富通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”）于2014年9月9日经中国证券监督管理委员会证监许可【2014】932 号文准予注册。本基金的基金合同于2014年11月13日正式生效。本基金类型为交易型开放式。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本基金投资于证券市场，基金资产净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括但不限于：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险，本基金的特定风险等。本基金属于债券型基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金，属于中风险/收益的开放式基金。本基金为被动式投资的交易型开放式指数证券投资基金，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。投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断基金的投资价值，自主、谨慎做出投资决策。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书和基金合同。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

本招募说明书所载内容截止日为2015年11月13日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年9月30日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：海富通基金管理有限公司
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
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
法定代表人：张文伟
成立时间：2003年4月18日
电话：021-38650999
联系人：吴晨莺
注册资本：1.5亿元人民币
股权结构：海通证券股份有限公司51%、法国巴黎投资管理BE控股公司49%。

（二）主要人员情况

张文伟先生，董事长，硕士，高级经济师。历任交通银行河南省分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长，海通证券办公室主任，海通证券投资银行总部副总经理、海富通基金管理有限公司董事、副总经理。2013年5月起任海富通基金管理有限公司董事长。

邵国有先生，董事，工商管理硕士，副教授。历任吉林大学校党委副书记、长春师范学院校党委书记、长春新世纪广场有限公司副董事长兼总经理、海通证券股份有限公司宣传培训中心总经理、海富通基金管理有限公司董事长。2013年5月起转任海富通基金管理有限公司董事。

吉宇光先生，董事，硕士，高级经济师。历任交通银行北京分行办公室副主任、交通银行北京分行证券部经理、海通证券北京朗家园营业部总经理等职。1997年至今任海通证券股份有限公司副总裁。2011年4月至今任海通国际证券集团有限公司董事会主席。

陶乐斯（Ligia Torres）女士，董事，法国与墨西哥双重国籍，双硕士学位，曾任职于东方汇理银行、渣打银行和欧洲联合银行，1996年加入法国巴黎银行集团工作，2010年3月至2013年6月任法国巴黎银行财产管理部英国地区首席执行官，2010年10月至今任法国巴黎银行英国控股有限公司董事，2013年7月至今任法国巴黎投资管理公司亚太区及新兴市场主管。

简伟信（Vincent Camerlynck）先生，董事，比利时国籍，国际政治学硕士，历任CL Global Partners（纽约）副总经理、汇丰投资银行（伦敦）副总经理、高盛投资银行（伦敦及巴黎）董事总经理、法国巴黎投资管理有限公司（伦敦）行政总裁兼董事，2012年9月至今任法国巴黎投资管理亚洲有限公司（香港）亚太区行政总裁。

刘颂先生，董事、总经理，英国籍，工商管理硕士。历任英国伦敦洛希尔父子有限公司投资银行助理，路透伦敦资产管理战略企划部全球总监，路透香港亚太区资产管理及研究总监，香港景顺投资管理有限公司驻北京办事处首席代表，景顺长城基金管理有限公司常务副总裁，德意志资产管理大中华区董事总经理。2015年3月加入海富通基金管理有限公司，现任海富通基金管理有限公司董事、总经理。

郑国汉先生，独立董事，经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济系副教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长、商学院院长及经济系讲座教授，现任香港岭南大学校长。

巴约特（Marc Bayot）先生，独立董事，比利时籍，布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学经济学荣誉教授，先锋投资（米兰及都柏林）独立副董事长，Fundconnect独立董事长、Degroof资产管理（布鲁塞尔）独立董事和法国巴黎银行B Control SICAV 独立董事。

杨国平先生，独立董事，硕士，高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记，上海市公用事业管理局党办副主任，上海市出租汽车公司党委书记，现任大众交通（集团）股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用事业（集团）股份有限公司董事长、上海交大昂立股份有限公司董事长。

张馨先生，独立董事，博士，教授。1984年7月至今任职于厦门大学经济学院，历任厦门大学经济学院教授、副院长兼财政系主任、院长。现任厦门大学经济学院教授、博士生导师。

李础前先生，监事长，经济学硕士，高级经济师。历任安徽省财政厅中企处副主任科员，安徽省国有资产管理局科长，海通证券计划财务部副总经理、总经理和财务总监。

魏海诺（Bruno Weil）先生，监事，法国籍，博士。历任巴黎银行东南亚负责人、亚洲融资项目副经理，法国巴黎银行跨国企业全球业务客户经理、亚洲金融机构投行业务部负责人、零售部中国代表，南京银行副行长。现任法国巴黎银行集团（中国）副董事长。

俞涛先生，监事，博士，CFA。先后就职于上投摩根基金管理有限公司、摩根资产管理（英国）有限公司。曾任上投摩根基金管理有限公司业务发展部总监。2012年11月起任海富通基金管理有限公司产品与创新总监，2015年12月起兼任海富通基金管理有限公司总经理助理。

陈虹女士，监事，法学士。历任香港的近律师事务所上海代表处律师，工银安盛人寿保险有限公司高级法律顾问，现任海富通基金管理有限公司高级法务经理。

奚万荣先生，督察长，经济学硕士，中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管，海通证券股份有限公司内部审计，2003年4月加入海富通基金管理有限公司，历任监事、监察稽核总监、总经理助理。2015年7月起，任海富通基金管理有限公司督察长兼上海富诚海富通资产管理有限公司监事。

章明女士，副总经理，硕士。历任加拿大BBCC Tech & Trade Int'l Inc公司高级财务经理、加拿大Future Electronics 公司产品专家，国信证券业务经理和副高级研究员，海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003年4月至2015年7月任海富通基金管理有限公司督察长，2015年7月起任海富通基金管理有限公司副总经理。

阎小庆先生，副总经理，硕士。历任中国人民银行上海分行助理经济师，富通银行欧洲管理实习生、法国东方汇理银行市场部副经理、法国农业信贷银行上海华东区首席代表，富通基金管理公司上海代表处首席代表，海富通基金管理有限公司市场总监，2006年5月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。2014年9月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事、总经理。

陶网雄先生，副总经理，硕士。历任中国电子器材华东公司会计科长，上海中土实业发展公司主管会计，海通证券股份有限公司财务副经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司，2003年4至2006年4月任公司财务部负责人，2006年4月起任财务总监。2013年4月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

戴德舜先生，副总经理，硕士。历任天同证券有限责任公司分析师，中银国际证券有限公司分析师，2004年3月加入海富通基金管理有限公司，历任股票分析师、组合经理、研究总监、股票绝对收益组合总监、投资总监。2014年11月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

何树方先生，副总经理，博士。历任山东济宁市财政贸易委员会副科长，魁北克蒙特利尔大学研究助理（兼职），魁北克公共退休金管理投资公司分析师、基金经理助理，富国基金管理有限公司总经理助理，2011年6月加入海富通基金管理有限公司，任总经理助理。2014年11月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

陈轶平先生，博士，特许金融分析师（CFA）。2009年1月至2009年8月任Mariner Investment Group LLC 分析师，2009年10月至2011年9月任瑞银企业管理（上海）有限公司副董事，2011年10月加入海富通基金管理有限公司，任债券投资经理，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基金经理，2015年12月起兼任海富通稳进增利债券型证券投资基金（LOF）与海富通稳固收益债券型证券投资基金基金经理。

投资决策委员会常设委员有：刘颂，总经理；戴德舜，副总经理；邵佳民，总经理助理；丁俊，投资副总监；杜晓海，量化投资部总监，兼任上海富诚海富通资产管理有限公司投资总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
法定代表人：田国立
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号
托管部门信息披露联系人：王永民
客服电话：95566
传真：（010）66594942

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、申购赎回代理券商（简称“一级交易商”）

1) 海通证券股份有限公司
地址：上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人：王开国
客户服务电话：021-95553或4008888001
联系人：李笑鸣
网址：www.htsec.com

2) 国信证券股份有限公司
地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层到26层
法定代表人：何如
客户服务电话：95536
联系人：齐晓燕
网址：www.guosen.com.cn

3) 光大证券股份有限公司
地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：郭新双
客户服务电话：95525
联系人：刘晨、李芳芳
网址：www.ebscn.com

4) 申万宏源证券有限公司
地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
法定代表人：李梅
客户服务电话：95523，4008895523
联系人：黄莹
网址：www.swhysc.com

5) 中信证券股份有限公司
地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
法定代表人：王东明
电话：95548
联系人：顾凌
网址：www.cs.ecitic.com

6) 中信证券(山东)有限责任公司
地址：青岛市崂山区深圳路222号天泰金融广场A座20层
法定代表人：杨宝林
客户服务电话：95548
联系人：吴忠超
网址：www.zxwt.com.cn

7) 德邦证券股份有限公司
住所：上海市福山路500号城建国际中心26层
法定代表人：姚文平
客户服务电话：400-8888-128
联系人：罗芳
网址：www.tebon.com.cn

8) 平安证券有限责任公司
地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人：谢永林
客户服务电话：95511转8
联系人：吴琼
网址：stock.pingan.com

9) 华宝证券有限责任公司
地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
法定代表人：陈林
客户服务电话：400-820-9898
联系人：刘闻川
网址：www.cnhbstock.com

10) 东兴证券股份有限公司
地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层
法定代表人：魏庆华
客户服务电话：4008-888-993
联系人：黄英
网址：www.dxzq.net

11) 长城证券股份有限公司
地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
客户服务电话：400-666-6888
联系人：高峰
网址：www.cgws.com

12) 信达证券股份有限公司
地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：张志刚
客户服务电话：400-800-8899
联系人：唐静
网址：www.cindasc.com

13) 华泰证券股份有限公司
地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
客户服务电话：95597
联系人：肖亦玲
网址：www.htsc.com.cn

14) 招商证券股份有限公司
地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人：宫少林
客户服务电话： 95565
联系人：林生迎
网址：www.newone.com.cn

15) 东北证券股份有限公司
地址：吉林省长春市自由大路1138号
法定代表人：杨树财
客户服务电话： 95360
联系人： 潘锴
网址：www.nesc.cn

16) 国都证券有限责任公司
地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层
法定代表人：常喆
客户服务电话：400-818-8118
联系人：黄静
网址：www.guodu.com

2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

二、登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
联系人：刘永卫
电话：（021）58872625
传真：（021）68870311

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路68号 时代金融中心19楼
办公地址：上海市银城中路68号 时代金融中心19楼
负责人：俞卫锋
电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：孙睿
联系电话：021-31358666
经办律师：黎明、孙睿

四、审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：李丹
经办注册会计师：陈玲、黄靖婷
电话：(021) 23238888
传真：(021) 23238800
联系人：黄靖婷

四、基金的名称

本基金的名称：海富通上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

基金类型：交易型开放式

六、基金的投资目标

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%。

七、投资方向和范围

本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。

为更好地实现基金的投资目标，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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

在建仓完成后，本基金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%。

八、基金的投资策略

一、投资策略

（一）分层抽样策略

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。

分层抽样复制法指的是采用一定的抽样方法从构成指数的成份债券中抽取若干成份券构成用于复制指数跟踪组合的方法。采取该方法可以在控制跟踪误差的基础上，进一步减少了组合维护及再平衡的所需的费用。

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。

（二）替代性策略

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。

替代组合的构建将以债券流动性为约束条件，按照与被替代债券久期相近、信用评级相似、到期收益率及剩余期限基本匹配为主要原则，控制替代组合与被替代债券的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（三）衍生品投资

未来，如法律法规或监管机构允许基金投资于其他与利率、标的指数、标的指数成份债券或构成基金组合的其他非成份债券相关的各种衍生工具，如远期、掉期、期权、期货等，以及其他投资品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金进行衍生品投资的目的是使基金的投资组合更紧密地跟踪业绩比较基准，以便更好地实现基金的投资目标。

二、投资管理体制和程序

1、决策依据

有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责制定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理负责日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

3、投资程序

研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估及组合维护等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

（1）研究支持：定量研究团队依托基金管理人整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果，开展指数跟踪、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策：投资决策委员会依据定量研究团队提供的研究报告，定期或遇重大事项时召开投资决策会议，决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，进行基金投资管理的日常决策。

（3）组合构建：根据标的指数情况，结合研究支持，基金经理以抽样复制标的指数成份债券及成份债券权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下，基金经理将采取适当的方法，降低买入成本、控制投资风险。

（4）交易执行：交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

（5）投资绩效评估：定量研究团队定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检视投资策略，进而调整投资组合。

（6）组合维护：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份债券基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理体制和程序做出调整，并在基金招募说明书中列示。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准即标的指数，上证可质押城投债指数。

上证可质押城投债指数由中证指数有限公司编制及发布，指数样本由沪市剩余期限1年以上、债项评级为投资级以上、符合中国证券登记结算有限责任公司对可质押债券要求的城投类债券样本组成，为债券投资者提供新的投资标的。

如果中证指数有限公司变更或停止上证可质押城投债指数的编制及发布，或者上证可质押城投债指数被其他指数所替代，或者由于指数编制方法等重大变更导致上证可质押城投债指数不宜继续作为本基金的标的指数，或者证券市场有其他代表性更强、更适合于投资的指数推出，基金管理人依据维护投资人合法权益的原则，经与托管人协商一致，通过适当的程序变更本基金的标的指数和业绩比较基准，并同时更换本基金的基金名称。若标的指数和业绩比较基准变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金的投资组合报告

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2015年12月10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。

本投资组合报告所载数据截止至2015年9月30日（“报告期末”）。

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	固定收益投资	5,827,899,247.10	94.64
	其中：债券	5,827,899,247.10	94.64
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	101,900,712.85	1.65
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	36,481,351.82	0.59
7	其他资产	191,752,569.12	3.11
8	合计	6,158,033,880.89	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	5,797,771,247.10	94.19
5	企业短期融资券	30,128,000.00	0.49
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	5,827,899,247.10	94.68

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	124487	14邵城投	834,390	92,124,999.90	1.50
2	124020	12辽城经	823,030	85,858,489.60	1.39
3	124736	14柳龙投	728,970	81,972,676.50	1.33
4	122719	12龙交投	728,970	81,877,910.40	1.33
5	124575	14汕投资	728,970	80,886,511.20	1.31

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。

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。

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。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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。

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。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

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。

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。

11、投资组合报告附注

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。

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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	32,888.02
2	应收证券清算款	194,583.46
3	应收股利	-
4	应收利息	191,511,327.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	13,769.86
8	其他	-
9	合计	191,752,569.12

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。

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。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2015年9月30日。

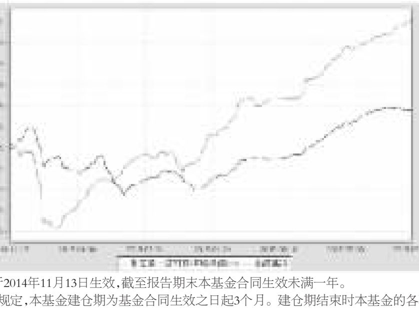
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

一、本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2014年11月13日-2014年12月31日	-2.45%	0.24%	-0.86%	0.15%	-1.59%	0.09%
2015年1月1日-2015年6月30日	4.47%	0.09%	0.61%	0.07%	3.86%	0.02%
2014年11月13日（基金合同生效日）-2015年9月30日	4.94%	0.13%	1.47%	0.08%	3.47%	0.05%

二、本基金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2015年9月30日）



注：1、本基金合同于2014年11月13日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、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。

十三、基金的费用和税收

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、基金的指数许可使用费；
4、基金上市费及年费；
5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
7、基金份额持有人大会费用；
8、基金的证券交易费用；
9、基金的银行汇划费用；
10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H=E\times 0.30\%\div$当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H=E\times 0.1\%\div$当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起2-5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。

在通常情况下，指数许可使用费按前一日的基金资产净值的0.02%的年费率计提。指数许可使用费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

$H=E\times 0.02\%\div$当年天数

H为每日应付的指数许可使用费，E为前一日的基金资产净值

自基金合同生效之日起，基金标的指数许可使用费按季支付。根据基金管理人与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的规定，指数许可使用费的收取下限为每季人民币25,000元（即不足25,000元部分按照25,000元收取）。但基金合同生效当季，基点费不设下限，按实际计提的金额支付。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

上述“一、基金费用的种类中第4—10项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3、《基金合同》生效前的相关费用；
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

海富通上证可质押城投债交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

一、“第三部分 基金管理人”部分：

1. 增加了陈虹女士的简历。
2.更新了邵国有先生、巴约特（Marc Bayot）先生、奚万荣先生、章明女士的简历。
3.删除了孟辉先生的简历。
4.更新了投资决策委员会的相关信息。

二、“第四部分 基金托管人”部分：更新了基金托管人的相关信息。

三、“第五部分 相关服务机构” 部分：

1.对基金份额发售机构信息进行了更新。
2.更新了审计基金财产的会计师事务所的信息。

四、“第十一部分 基金的投资”和“第十二部分 基金的业绩”部分：根据2015年第三季度报告，更新了基金投资组合报告和基金业绩的内容，相关数据截止期为2015年9月30日。

海富通基金管理有限公司
2015年12月26日

证券代码：002078　　证券简称：太阳纸业　　公告编号：2015-088

山东太阳纸业股份有限公司
2015年第四次临时股东大会决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、重要提示

1、本次会议采取现场投票和网络投票相结合的表决方式；

2、本次股东大会无增加、变更、否决提案的情况。

二、会议召开的情况

1、股东大会届次：2015年第四次临时股东大会

2、会议召集人：公司董事会

3、会议主持人：董事长李洪信先生

4、会议召开方式：本次股东大会采取现场投票、网络投票相结合的方式。

5、会议召开的日期、时间：

（1）现场会议时间：2015年12月25日下午14:00。

（2）网络投票时间：2015年12月24日至12月25日。

通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的具体时间为2015年12月25日的交易时间，即上午9:30-11:30和下午13:00-15:00；

通过深圳证券交易所互联网投票系统进行网络投票的时间为2015年12月24日下午15:00至2015年12月25日下午15:00期间的任意时间。

6、股权登记日：2015年12月21日

7、现场会议召开地点：山东省济宁市兖州区友谊路一号公司办公楼会议室。

8、本次会议的召开符合《公司法》、《证券法》、《上市公司股东大会议事规则》、《深圳证券交易所股票上市规则》及《公司章程》等法律、法规及规范性文件的规定。

三、会议的出席情况

1、出席会议的总体情况

参加本次会议表决的股东及股东委托代理人共8名，代表有表决权股份1,419,905,334股，占公司股份总数的55.9760%。

2、现场会议出席情况

出席本次股东大会现场会议的股东及股东委托代理人共2名，代表有表决权股份1,419,807,434股，占公司股份总数的55.9721%。

3、网络投票情况

通过网络投票的股东6人，代表股份97,900股，占上市公司总股份的0.0039%。

公司全体董事、全体监事及部分高级管理人员等出席了本次会议，北京德恒律师事务所律师列席了本次股东大会进行见证，并出具了法律意见书。

四、提案审议和表决情况

本次股东大会按照会议议程审议会议议案，并采用现场记名投票与网络投票相结合的方式进行了表决。

审议表决结果如下：

（一）审议通过了《关于选举公司第六届董事会非独立董事的议案》、《关于选举公司第六届董事会独立董事的议案》

上述议案采取累积投票制选举李洪信先生、李娜女士、刘泽华先生、王宗良先生、赵伟先生、陈关亭先生、罗奕先生为公司第六届董事会董事，其中赵伟先生、陈关亭先生、罗奕先生为公司为第六届董事会独立董事；任期三年，自2015年12月25日起至第六届董事会任期届满时止。具体表决结果如下：

1、选举第六届董事会非独立董事

1）选举第六届董事会董事候选人李洪信先生为公司董事

表决结果为：同意1,419,807,436股，占出席会议所有股东所持股份总数的 99.9931%，其中中小投资者同意2,451,752股，占出席会议中小股东所持股份的96.1603%。

2）选举第六届董事会董事候选人李娜女士为公司董事

表决结果为：同意1,419,807,436股，占出席会议所有股东所持股份总数的 99.9931%，其中中小投资者同意2,451,752股，占出席会议中小股东所持股份的96.1603%。

3）选举第六届董事会董事候选人刘泽华先生为公司董事

表决结果为：同意1,419,807,436股，占出席会议所有股东所持股份总数的 99.9931%，其中中小投资者同意2,451,752股，占出席会议中小股东所持股份的96.1603%。

4）选举第六届董事会董事候选人王宗良先生为公司董事

表决结果为：同意1,419,807,436股，占出席会议所有股东所持股份总数的 99.9931%，其中中小投资者同意2,451,752股，占出席会议中小股东所持股份的96.1603%。

2、选举第六届董事会独立董事

1）选举第六届董事会董事候选人赵伟先生为公司独立董事

表决结果为：同意1,419,807,436股，占出席会议所有股东所持股份总数的 99.9931%，其中中小投资者同意2,451,752股，占出席会议中小股东所持股份的96.1603%。

2）选举第六届董事会董事候选人陈关亭先生为公司独立董事

表决结果为：同意1,419,807,436股，占出席会议所有股东所持股份总数的 99.9931%，其中中小投资者同意2,451,752股，占出席会议中小股东所持股份的96.1603%。

3）选举第六届董事会董事候选人罗奕先生为公司独立董事

表决结果为：同意1,419,807,436股，占出席会议所有股东所持股份总数的 99.9931%，其中中小投资者同意2,451,752股，占出席会议中小股东所持股份的96.1603%。

（二）审议通过了《关于公司监事会换届选举的议案》

该议案采取累积投票制选吴延民先生、杨林娜女士为公司为第六届监事会股东代表监事，与职工代表监事王涛先生共同组成公司第六届监事会；前述监事任期三年，自2015年12月25日起至第六届监事会任期届满时止。表决结果如下：

1、选举吴延民先生为公司股东代表监事

表决结果为：同意1,419,807,434股，占出席会议所有股东所持股份总数的 99.9931%，其中中小投资者同意2,451,750股，占出席会议中小股东所持股份的96.1603%。

2、选举杨林娜女士为公司股东代表监事

表决结果为：同意1,419,807,434股，占出席会议所有股东所持股份总数的 99.9931%，其中中小投资者同意2,451,750股，占出席会议中小股东所持股份的96.1603%。

（三）审议通过了《关于确定公司第六届董事会独立董事津贴和第六届监事会监事津贴的议案》

该议案的表决结果为： 赞成的股数1,419,834,234股， 占出席会议有表决权股份总数的99.9950%；反对的股数34,800股，占出席会议有表决权股份总数的0.0025%；弃权的股数36,300股(其中，因未投票默认弃权36,300股)，占出席会议有表决权股份总数的0.0025%。

其中，出席会议的中小投资者的表决情况：同意2,478,550股，占出席会议中小股东所持股份的97.2114%；反对34,800股，占出席会议中小股东所持股份的1.3649%；弃权36,300股（其中，因未投票默认弃权36,300股），占出席会议中小股东所持股份的1.4237%。

（四）审议通过了《关于公司符合发行公司债券条件的议案》

该议案的表决结果为： 赞成的股数1,419,834,234股， 占出席会议有表决权股份总数的99.9950%；反对的股数71,100股，占出席会议有表决权股份总数的0.0050%；弃权的股数0股(其中，因未投票默认弃权0股)，占出席会议有表决权股份总数的0.0000%。

其中，出席会议的中小投资者的表决情况：同意2,478,550股，占出席会议中小股东所持股份的97.2114%；反对71,100股，占出席会议中小股东所持股份的2.7886%；弃权0股（其中，因未投票默认弃权0股），占出席会议中小股东所持股份的0.0000%。

（五）逐项审议通过了《关于公司公开发行公司债券方案的议案》

1、发行规模

表决结果为：赞成的股数1,419,834,234股，占出席会议有表决权股份总数的99.9950%；反对的股数71,100股，占出席会议有表决权股份总数的0.0050%；弃权的股数0股(其中，因未投票默认弃权0股)，占出席会议有表决权股份总数的0.0000%。

其中，出席会议的中小投资者的表决情况：同意2,478,550股，占出席会议中小股东所持股份的97.2114%；反对71,100股，占出席会议中小股东所持股份的2.7886%；弃权0股（其中，因未投票默认弃权0股），占出席会议中小股东所持股份的0.0000%。

2、发行对象及向公司股东配售的安排

表决结果为：赞成的股数1,419,834,234股，占出席会议有表决权股份总数的99.9950%；反对的股数71,100股，占出席会议有表决权股份总数的0.0050%；弃权的股数0股(其中，因未投票默认弃权0股)，占出席会议有表决权股份总数的0.0000%。

其中，出席会议的中小投资者的表决情况：同意2,478,550股，占出席会议中小股东所持股份的97.2114%；反对71,100股，占出席会议中小股东所持股份的2.7886%；弃权0股（其中，因未投票默认弃权0股），占出席会议中小股东所持股份的0.0000%。

3、发行方式

表决结果为：赞成的股数1,419,834,234股，占出席会议有表决权股份总数的99.9950%；反对的股数71,100股，占出席会议有表决权股份总数的0.0050%；弃权的股数0股(其中，因未投票默认弃权0股)，占出席会议有表决权股份总数的0.0000%。

其中，出席会议的中小投资者的表决情况：同意2,478,550股，占出席会议中小股东所持股份的97.2114%；反对71,100股，占出席会议中小股东所持股份的2.7886%；弃权0股（其中，因未投票默认弃权0股），占出席会议中小股东所持股份的0.0000%。

4、发行期限

表决结果为：赞成的股数1,419,834,234股，占出席会议有表决权股份总数的99.9950%；反对的股数71,100股，占出席会议有表决权股份总数的0.0050%；弃权的股数0股(其中，因未投票默认弃权0股)，占出席会议有表决权股份总数的0.0000%。

其中，出席会议的中小投资者的表决情况：同意2,478,550股，占出席会议中小股东所持股份的97.2114%；反对71,100股，占出席会议中小股东所持股份的2.7886%；弃权0股（其中，因未投票默认弃权0股），占出席会议中小股东所持股份的0.0000%。

5、债券利率

表决结果为：赞成的股数1,419,834,234股，占出席会议有表决权股份总数的99.9950%；反对的股数71,100股，占出席会议有表决权股份总数的0.0050%；弃权的股数0股(其中，因未投票默认弃权0股)，占出席会议有表决权股份总数的0.0000%。

其中，出席会议的中小投资者的表决情况：同意2,478,550股，占出席会议中小股东所持股份的97.2114%；反对71,100股，占出席会议中小股东所持股份的2.7886%；弃权0股（其中，因未投票默认弃权0股），占出席会议中小股东所持股份的0.0000%。

6、募集资金用途

表决结果为：赞成的股数1,419,834,234股，占出席会议有表决权股份总数的99.9950%；反对的股数71,100股，占出席会议有表决权股份总数的0.0050%；弃权的股数0股(其中，因未投票默认弃权0股)，占出席会议有表决权股份总数的0.0000%。

其中，出席会议的中小投资者的表决情况：同意2,478,550股，占出席会议中小股东所持股份的97.2114%；反对71,100股，占出席会议中小股东所持股份的2.7886%；弃权0股（其中，因未投票默认弃权0股），占出席会议中小股东所持股份的0.0000%。

7、拟上市交易所

表决结果为：赞成的股数1,419,834,234股，占出席会议有表决权股份总数的99.9950%；反对的股数71,100股，占出席会议有表决权股份总数的0.0050%；弃权的股数0股(其中，因未投票默认弃权0股)，占出席会议有表决权股份总数的0.0000%。

其中，出席会议的中小投资者的表决情况：同意2,478,550股，占出席会议中小股东所持股份的97.2114%；反对71,100股，占出席会议中小股东所持股份的2.7886%；弃权0股（其中，因未投票默认弃权0股），占出席会议中小股东所持股份的0.0000%。

8、担保安排

表决结果为：赞成的股数1,419,834,234股，占出席会议有表决权股份总数的99.9950%；反对的股数71,100股，占出席会议有表决权股份总数的0.0050%；弃权的股数0股(其中，因未投票默认弃权0股)，占出席会议有表决权股份总数的0.0000%。

其中，出席会议的中小投资者的表决情况：同意2,478,550股，占出席会议中小股东所持股份的97.2114%；反对71,100股，占出席会议中小股东所持股份的2.7886%；弃权0股（其中，因未投票默认弃权0股），占出席会议中小股东所持股份的0.0000%。

9、有效期

表决结果为：赞成的股数1,419,834,234股，占出席会议有表决权股份总数的99.9950%；反对的股数71,100股，占出席会议有表决权股份总数的0.0050%；弃权的股数0股(其中，因未投票默认弃权0股)，占出席会议有表决权股份总数的0.0000%。

其中，出席会议的中小投资者的表决情况：同意2,478,550股，占出席会议中小股东所持股份的97.2114%；反对71,100股，占出席会议中小股东所持股份的2.7886%；弃权0股（其中，因未投票默认弃权0股），占出席会议中小股东所持股份的0.0000%。

10、偿债保障措施

表决结果为：赞成的股数1,419,834,234股，占出席会议有表决权股份总数的99.9950%；反对的股数71,100股，占出席会议有表决权股份总数的0.0050%；弃权的股数0股(其中，因未投票默认弃权0股)，占出席会议有表决权股份总数的0.0000%。

其中，出席会议的中小投资者的表决情况：同意2,478,550股，占出席会议中小股东所持股份的97.2114%；反对71,100股，占出席会议中小股东所持股份的2.7886%；弃权0股（其中，因未投票默认弃权0股），占出席会议中小股东所持股份的0.0000%。

11、本次发行对董事会的授权事项

表决结果为：赞成的股数1,419,834,234股，占出席会议有表决权股份总数的99.9950%；反对的股数71,100股，占出席会议有表决权股份总数的0.0050%；弃权的股数0股(其中，因未投票默认弃权0股)，占出席会议有表决权股份总数的0.0000%。

其中，出席会议的中小投资者的表决情况：同意2,478,550股，占出席会议中小股东所持股份的97.2114%；反对71,100股，占出席会议中小股东所持股份的2.7886%；弃权0股（其中，因未投票默认弃权0股），占出席会议中小股东所持股份的0.0000%。

（六）审议通过了《关于修订公司<章程>的议案》

该议案的表决结果为： 赞成的股数1,419,834,234股， 占出席会议有表决权股份总数的99.9950%；反对的股数34,800股，占出席会议有表决权股份总数的0.0025%；弃权的股数36,300股(其中，因未投票默认弃权36,300股)，占出席会议有表决权股份总数的0.0025%。

其中，出席会议的中小投资者的表决情况：同意2,478,550股，占出席会议中小股东所持股份的97.2114%；反对34,800股，占出席会议中小股东所持股份的1.3649%；弃权36,300股（其中，因未投票默认弃权36,300股），占出席会议中小股东所持股份的1.4237%。

（七）审议通过了《关于修订公司<股东大会议事规则>的议案》

该议案的表决结果为： 赞成的股数1,419,834,234股， 占出席会议有表决权股份总数的99.9950%；反对的股数34,800股，占出席会议有表决权股份总数的0.0025%；弃权的股数36,300股(其中，因未投票默认弃权36,300股)，占出席会议有表决权股份总数的0.0025%。

其中，出席会议的中小投资者的表决情况：同意2,478,550股，占出席会议中小股东所持股份的97.2114%；反对34,800股，占出席会议中小股东所持股份的1.3649%；弃权36,300股（其中，因未投票默认弃权36,300股），占出席会议中小股东所持股份的1.4237%。

（八）审议通过了《关于公司为控股子公司兖州天章纸业有限公司提供连带责任担保的议案》

该议案的表决结果为： 赞成的股数1,419,834,234股， 占出席会议有表决权股份总数的99.9950%；反对的股数34,800股，占出席会议有表决权股份总数的0.0025%；弃权的股数36,300股(其中，因未投票默认弃权36,300股)，占出席会议有表决权股份总数的0.0025%。

其中，出席会议的中小投资者的表决情况：同意2,478,550股，占出席会议中小股东所持股份的97.2114%；反对34,800股，占出席会议中小股东所持股份的1.3649%；弃权36,300股（其中，因未投票默认弃权36,300股），占出席会议中小股东所持股份的1.4237%。

所有议案同意股数均超过出席会议有表决权股东所持表决权股份总数的2/3以上。

公司2015年第四次临时股东大会所有议案已经公司于2015年12月9日召开的第五届董事会第二十八次会议和第五届监事会第十九会议审议通过，相关内容详见刊登在2015年12月10日巨潮资讯网（http://www.cninfo.com.cn）及《证券时报》、《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》上的相关公告和文件。

五、律师出具的法律意见

本次临时股东大会由北京德恒律师事务所黄侦武律师、王瑞杰律师现场见证并出具了法律意见书。该法律意见书认为：公司本次股东大会的召集和召开程序、出席会议人员和召集人资格、会议审议事项和表决程序、会议表决结果均符合我国相关法律、法规、规范性文件和《公司章程》的规定，会议形成的决议合法、有效。

六、备查文件

1、经与会董事和记录人签字确认并加盖董事会印章的股东大会决议；
2、北京德恒律师事务所出具的法律意见书；
3、本次临时股东大会全套会议资料。

特此公告。

山东太阳纸业股份有限公司
董 事 会
二〇一五年十二月二十六日