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

（2017年第1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。

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。

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本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2017年5月13日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年3月31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%、法国巴黎资产管理BE控股公司(原法国巴黎投资管理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、鞍荆山支行行长、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。2017年2月起代行总经理职责。

杨明先生，董事，管理学学士。历任中国人民银行新余支行科员，交通银行新余支行办公室科员、证券业务部负责人、证券业务部副主任、证券业务部主任，海通证券有限公司新余营业部总经理，海通证券股份有限公司江苏分公司筹备负责人、总经理、党委副书记，现任海通证券股份有限公司人力资源部总经理、党委组织部部长。

吴淑琨先生，董事，管理学博士。历任南京大学副教授，海通证券股份有限公司研究所宏观研究部经理、所长助理，机构业务部副总经理、企业及私人客户服务部副总主持、企业金融部总经理。现任海通证券股份有限公司战略发展部总经理。

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月至今任法国巴黎资产管理（原：法国巴黎投资管理）公司亚太区CEO。

黄金源(Alex NG Kim Guan)先生，董事，马来西亚国籍，文学学士，历任荷兰通用投资银行新加坡代表处客服主任，荷兰通用资本市场远东区域香港公司证券部经理，法国巴黎资产管理（原：法国巴黎投资管理）亚洲有限公司董事，现任法国巴黎资产管理（原：法国巴黎投资管理）亚洲有限公司亚太区投资总监。

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贸产管理（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。

李硕前先生，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。2014年7月至2016年1月任海富通基金管理有限公司高级法务经理，现任海富通基金管理有限公司法律部总经理。

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。2016年12月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事。

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。

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，CFA。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，现任固定收益投资部副总监兼债券基金部总监。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基金经理。2015年12月起兼任海富通稳固收益债券和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月起兼任海富通瑞益债券和海富通瑞丰一年定开债券基金经理。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月起兼任海富通富源债券和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。

陆丛凡先生，硕士。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月起任海富通上证可质押城投债ETF基金经理助理。

投资决策委员会常设委员有：张文伟，董事长(代行总经理)；胡光涛，总经理助理；王智慧，总经理助理；杜晓海，多资产策略投资部总监；黄东升，机构权益投资部总监；王金祥，研究部副总监；陈甄瑛，量化投资部总监；陈轶平，固定收益投资部副总监。投资决策委员会主席由董事长(代行总经理)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：周杰

客户服务电话：95553或4008888001

联系人：李荣鸣

网址：www.htsec.com

（2）国信证券股份有限公司

地址：广东省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：周杨

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或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：张佑君

电话：95548

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号青岛国际金融广场1号楼20层

法定代表人：杨宝林

客户服务电话：95548

联系人：赵艳青

网址：www.citicssd.com

（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29层

法定代表人：姚文平

客户服务电话：4008888128

联系人：朱磊

网址：www.tebon.com.cn

（8）平安证券股份有限公司

地址：广东省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：詹露阳

客户服务电话：95511转8

联系人：周一涵

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：4008209898

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：4008888993

联系人：汤漫川

网址：www.dxzq.net

（11）长城证券股份有限公司

地址：广东省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：丁益

客户服务电话：4006666888

联系人：郑舒丽

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：95321

联系人：尹旭航

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：广东省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：吉林省长春市生态大街6666号

法定代表人：李福春

客户服务电话：95360

联系人：安岩岩

网址：www.nesc.cn

（16）国都证券股份有限公司

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：王少华

客户服务电话：4008188118

联系人：黄静

网址：www.guodu.com

（17）国泰君安证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区商城路618号

法定代表人：杨德红

客户服务电话：95521

联系人：丙敏祺、吴倩

网址：www.gtja.com

（18）西藏东方财富证券股份有限公司

地址：上海市闸北区永和路118弄24号

法定代表人：贾绍君

客户服务电话：4008811177

联系人：周艳琼

网址：www.xzsec.com

（19）中泰证券股份有限公司

地址：山东省济南市市中区经七路86 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

联系人：孙豪志

网址：www.zts.com.cn

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、都晓燕

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：都晓燕

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、投资方向和投资范围

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期久期、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2017年6月8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2017年3月31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	5,481,708,104.60	92.01
	其中：债券	5,481,708,104.60	92.01
	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	292,261,468.34	4.91
	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	8,569,252.69	0.14
7	其他资产	175,300,050.95	2.94
8	合计	5,957,838,876.58	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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。

2.2报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

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	40,097,694.70	0.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	5,441,610,409.90	91.41
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,481,708,104.60	92.09

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	122719	12老交投	727,070	80,901,078.90	1.36
2	124797	14十二师	727,070	77,571,098.30	1.30
3	124654	14庆经投	727,070	76,349,620.70	1.28
4	124888	14鄂城债	727,070	75,687,987.00	1.27
5	124575	14汕投资	727,070	72,110,802.60	1.21

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PR邵城债（124487）的发行人于2017年1月5日受到交易商协会自律处分，因发行人未能按照相关自律规则的规定及时披露2016年第三季度财务信息。

对该证券的投资决策程序的说明：公司为邵阳市基建投融资主体，同时经营自来水、燃气等公益性较强的业务，业务风险不大，而且政府支持力度较大，且本期债券已经开始提前还本，总体信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	47,722.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	175,252,328.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	175,300,050.95

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2017年3月31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12月31日	11.04%	0.08%	2.86%	0.06%	8.18%	0.02%
2016年1月1日-2016年12月31日	2.16%	0.09%	-1.68%	0.06%	3.84%	0.03%
2014年11月13日(低金合同生效日)-2017年3月31日	11.20%	0.10%	-0.99%	0.07%	12.19%	0.03%

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2017年3月31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。

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×0.30%÷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×0.1%÷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×0.02%÷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.更新了基金管理人概况的相关信息。

2.更新了张文伟先生、陶乐斯女士、黄金源先生、陈虹女士、章明女士、陈轶平先生的简历。

3.删除了刘颂先生、黄正红先生的简历。

4.增加了吴淑琨先生、陆丛凡先生的简历。

5.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.更新了基金份额发售机构的部分信息。

2.更新了审计基金财产的会计师事务所的相关信息。

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2017年第一季度报告，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2017年3月31日。

海富通基金管理有限公司

2017年6月26日

海富通基金管理有限公司关于海富通季季通利理财债券型证券投资基金新增中国工商银行股份有限公司为销售机构的公告

一、中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）的开放式基金代销资格已获中国证券监督管理委员会批准。根据海富通基金管理有限公司目前与工商银行签署的开放式证券投资基金销售协议，现增加工商银行为海富通季季通利理财债券型证券投资基金（简称：海富通季季通利理财债券A，基金代码：004577；海富通季季通利理财债券B，基金代码：004578）的销售机构。

投资者欲了解基金的详细信息，请仔细阅读《海富通季季通利理财债券型证券投资基金基金合同》、《海富通季季通利理财债券型证券投资基金招募说明书》及相关法律文件。

二、自2017年6月27日起，投资者可以在工商银行各网点办理上述开放式基金的开户、认购等业务。

三、投资者可通过以下途径咨询有关详情：

1. 工商银行网站：www.icbc.com.cn

工商银行客户服务热线：95588

2. 海富通基金管理有限公司网站：www.hftfund.com

海富通基金管理有限公司全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

本公告的解释权归海富通基金管理有限公司。

特此公告。

海富通基金管理有限公司

2017年6月26日

股票简称：天房发展　股票代码：600322　公告编号：2017—035

债券简称：16天房01　债券代码：135607

天津市房地产发展（集团）股份有限公司非公开发行2016年公司债券（第一期）（品种一）2017年付息公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

重要内容提示：

●债权登记日：2017年6月30日

●债券付息日：2017年7月3日（因2017年7月1日为节假日，故顺延至其后的第一个交易日）

由天津市房地产发展（集团）股份有限公司（以下简称“本公司”）于2016年7月1日发行的天津市房地产发展（集团）股份有限公司非公开发行2016年公司债券（第一期）（品种一）（以下简称“本期债券”）将于2017年7月3日（因2017年7月1日为节假日，故顺延至其后的第一个交易日）开始支付自2017年4月1日至2017年6月30日期间（以下简称“本季度”）的利息。根据《天津市房地产发展（集团）股份有限公司非公开发行2016年公司债券（第一期）募集说明书》有关条款的规定，现将有关事宜公告如下：

一、本期债券基本情况

（一）债券名称：天津市房地产发展（集团）股份有限公司非公开发行2016年公司债券（第一期）（品种一）；

（二）债券简称及代码：16天房01（代码：135607）；

（三）发行人：天津市房地产发展（集团）股份有限公司；

（四）发行总额：人民币8.70亿元

（五）债券期限和利率：本期债券为5年期（3+2年期），票面年利率为6.99%。发行人有权决定是否在本期债券存续期的第3年末调整本期债券后2年的票面利率。发行人将于2019年7月1日前的第30个交易日，在相关信息披露媒体上发布关于是否调整本期债券票面利率以及调整幅度的公告。若发行人未行使利率调整选择权，则本期债券后续期限票面利率仍维持原有票面利率不变。发行人发出关于是否调整本期债券票面利率及调整幅度的公告后，债券持有人有权选择在2019年7月1日将其持有的本期债券全部或部分按面值回售给发行人，2019年7月1日即为回售支付日，发行人将按照上海证券交易所和债券登记机构相关业务规则完成回售支付工作。

（六）债券形式：实名制记账式公司债券。投资者认购的本期债券在登记机构开立的托管账户托管记载。本期债券发行结束后，债券持有人可按照有关主管机构的规定进行债券的转让、质押等操作；

（七）计息期限：本期债券的计息期限为2016年7月1日至2021年6月30日；

（八）付息日：本次债券存续期内每年的10月1日、1月1日、4月1日、7月1日为上一个计息季度的付息日（如遇法定节假日或休息日延至其后的第1个交易日；每次付息款项不另计利息）；

（九）兑付日：本期债券的兑付日为2021年7月1日。（如遇法定节假日和/或休息日，则顺延至其后的第1个交易日；顺延期间兑付款项不另计利息）。如投资者行使回售选择权，则其回售部分债券的兑付日为2019年7月1日（如遇法定及政府指定节假日或休息日，则顺延至其后的第1个交易日，顺延期间兑付款项不另计息）。在兑付登记日次日至兑付日期间，本次债券停止交易；

（十）上市时间及地点：本期债券于2016年8月19日在上海证券交易所挂牌。

二、本期债券本次付息方案

根据《天津市房地产发展（集团）股份有限公司非公开发行2016年公司债券（第