

上证10年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

《上证10年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金》(以下简称“本基金”)《上市交易公告书》(以下简称“本公告”)根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,海富通基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)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。本基金托管人中国银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会(以下简称“中国证监会”)和上海证券交易所对基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对基金的投资价值、市场前景及基金价格的任何保证,请投资者仔细阅读2018年6月25日刊登于《中国证券报》《上海证券报》和《中国证券报》及海富通基金管理有限公司网站(www.hftfund.com)上的《上证10年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

一、重要声明与提示

- 1.基金一级市场交易简况:10年期地债。
- 2.二级市场交易代码:511270。
- 3.基金申购赎回简称:10年期地债。
- 4.申购赎回代码:511270。
- 5.2018年11月15日基金净值:60.457,471.00份。
- 6.2018年11月15日基金份额净值:101.7698元。
- 7.本次上市交易的价格:60.457,471元。
- 8.上市交易的证券交易所:上海证券交易所。
- 9.上市交易日期:2018年11月22日。

二、基金的投资目标、范围及策略

(一)本基金的投资目标:本基金通过投资于上证10年期地方政府债,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争实现与标的指数收益的正向同步增长,谋求超越业绩比较基准的投资回报。

(二)本基金的投资范围:本基金的投资范围包括上证10年期地方政府债,以及中国证监会允许基金管理人进行境外证券投资的金融衍生品等。

(三)本基金的投资策略:本基金采取自上而下的资产配置策略,在严格控制基金投资组合风险的前提下,根据标的指数的表现,动态调整基金投资组合中各成份券的权重,力求实现与标的指数收益的正向同步增长,谋求超越业绩比较基准的投资回报。

(四)本基金的风险收益特征:本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益水平低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。

(五)基金管理人承诺:本基金管理人承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,以基金份额持有人的利益为最高准则,为基金份额持有人提供优质的投资管理服务。

(六)基金托管人承诺:基金托管人承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(七)基金销售机构承诺:基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪守诚信、勤勉、尽责的原则,为基金份额持有人提供优质的投资管理服务。

(八)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(九)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(十)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(十一)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(十二)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(十三)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(十四)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(十五)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(十六)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(十七)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(十八)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(十九)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(二十)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(二十一)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(二十二)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(二十三)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(二十四)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(二十五)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(二十六)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(二十七)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(二十八)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(二十九)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(三十)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(三十一)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(三十二)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

(三十三)基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺:基金管理人、基金托管人、基金销售机构承诺严格遵守法律法规及中国证监会的有关规定,恪尽职守,诚实信用,勤勉尽责,按照法律法规及基金合同的约定,安全保管基金财产,并按照规定履行监督和复核职责。

海富通基金管理有限公司 公告日期:2018年11月17日 上市日期:2018年11月22日

注:截至2018年11月15日,基金份额净值101.7698元,基金份额总额60,457,471.00份。

2.本报告期自2018年10月12日起至2018年11月15日止,本基金合同于2018年10月12日生效,截至本报告期末本基金合同生效未满半年。

截至2018年11月15日,本基金的投资组合情况如下:

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比 例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中:股票	-	-
3	固定收益投资	6,056,995,000.00	97.62
4	其中:国债	6,056,995,000.00	97.62
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	50,000,000.00	0.81
7	银行存款和结算备付金合计	48,344,764.39	0.78
8	其他资产	49,378,443.01	0.79
9	合计	6,204,717,207.40	100.00

(二)截至2018年11月15日,按行业分类的股票投资组合情况如下:

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国防装备	-	-
2	医疗保健	-	-
3	金融服务	-	-
4	公用事业	-	-
5	信息技术	-	-
6	工业周期	-	-
7	其他	6,056,995,000.00	98.45
8	合计	6,056,995,000.00	98.45

(三)截至2018年11月15日,按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细如下:

序号	证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国防装备	-	-
2	医疗保健	-	-
3	金融服务	-	-
4	公用事业	-	-
5	信息技术	-	-
6	工业周期	-	-
7	其他	6,056,995,000.00	98.45
8	合计	6,056,995,000.00	98.45

(四)按资产类别分类的债券投资组合情况如下:

序号	债券类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	6,056,995,000.00	97.62
2	央行票据	-	-
3	金融债	-	-
4	地方政府债	-	-
5	企业债	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	6,056,995,000.00	98.45
8	合计	6,056,995,000.00	98.45

(五)按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细如下:

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	147575	188,120.10	3.00
2	149891	177,223.20	2.92
3	130652	152,512.40	2.50
4	130859	162,794.30	2.69
5	130607	152,512.40	2.50

(六)投资组合报告附注

1.本基金合同生效日至2018年11月15日,本基金投资的前十名证券中没有出现发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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。

3.其他资产构成如下:

序号	资产名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收股利	249,578,930.71
3	应收利息	-
4	应收申购款	48,329,932.60
5	其他应收款	-
6	其他流动资产	230,000.00
7	待摊费用	-
8	其他资产	-
9	合计	298,038,863.31

4.权益投资情况

截至2018年11月15日,本基金未持有权益投资。自基金合同生效日至2018年11月15日,本基金未持有权益投资。

5.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

6.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

7.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

8.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

9.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

10.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

11.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

12.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

13.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

14.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

15.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

16.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

17.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

18.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

19.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

20.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

21.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

22.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

23.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

24.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

25.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

26.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

27.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

28.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

29.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

海富通基金管理有限公司 公告日期:2018年11月17日 上市日期:2018年11月22日

注:截至2018年11月15日,基金份额净值101.7698元,基金份额总额60,457,471.00份。

2.本报告期自2018年10月12日起至2018年11月15日止,本基金合同于2018年10月12日生效,截至本报告期末本基金合同生效未满半年。

截至2018年11月15日,本基金的投资组合情况如下:

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比 例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中:股票	-	-
3	固定收益投资	6,056,995,000.00	97.62
4	其中:国债	6,056,995,000.00	97.62
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	50,000,000.00	0.81
7	银行存款和结算备付金合计	48,344,764.39	0.78
8	其他资产	49,378,443.01	0.79
9	合计	6,204,717,207.40	100.00

(二)截至2018年11月15日,按行业分类的股票投资组合情况如下:

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国防装备	-	-
2	医疗保健	-	-
3	金融服务	-	-
4	公用事业	-	-
5	信息技术	-	-
6	工业周期	-	-
7	其他	6,056,995,000.00	98.45
8	合计	6,056,995,000.00	98.45

(三)截至2018年11月15日,按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细如下:

序号	证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国防装备	-	-
2	医疗保健	-	-
3	金融服务	-	-
4	公用事业	-	-
5	信息技术	-	-
6	工业周期	-	-
7	其他	6,056,995,000.00	98.45
8	合计	6,056,995,000.00	98.45

(四)按资产类别分类的债券投资组合情况如下:

序号	债券类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	6,056,995,000.00	97.62
2	央行票据	-	-
3	金融债	-	-
4	地方政府债	-	-
5	企业债	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	6,056,995,000.00	98.45
8	合计	6,056,995,000.00	98.45

(五)按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细如下:

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	147575	188,120.10	3.00
2	149891	177,223.20	2.92
3	130652	152,512.40	2.50
4	130859	162,794.30	2.69
5	130607	152,512.40	2.50

(六)投资组合报告附注

1.本基金合同生效日至2018年11月15日,本基金投资的前十名证券中没有出现发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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。

3.其他资产构成如下:

序号	资产名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收股利	249,578,930.71
3	应收利息	-
4	应收申购款	48,329,932.60
5	其他应收款	-
6	其他流动资产	230,000.00
7	待摊费用	-
8	其他资产	-
9	合计	298,038,863.31

4.权益投资情况

截至2018年11月15日,本基金未持有权益投资。自基金合同生效日至2018年11月15日,本基金未持有权益投资。

5.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

6.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

7.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

8.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

9.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

10.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

11.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。

12.本基金投资的前十名债券中,没有投资于超出基金合同规定备选债券库之外的债券。