
国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金
上市交易公告书

国泰基金管理有限公司

二〇一六年八月三日

目 录

一、重要声明与提示.....	3
二、基金概览.....	3
三、基金的募集与上市交易.....	4
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	6
五、基金主要当事人简介	7
六、基金合同摘要	13
七、基金财务状况	13
八、基金投资组合	15
九、重大事项揭示	18
十、基金管理人承诺.....	18
十一、基金托管人承诺	19
十二、基金上市推荐人意见.....	19
十三、备查文件目录.....	20

一、重要声明与提示

国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《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内容与格式准则第 1 号<上市交易公告书的内容与格式>》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，国泰基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本公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。本基金托管人中国建设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。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资人详细查阅刊登在 2016 年 6 月 15 日《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》及本基金管理人网站（www.gtfund.com）上的《国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）

二、基金概览

- 1、基金名称：国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金。
- 2、基金简称：国泰中证军工 ETF。
- 3、基金二级市场交易简称：军工 ETF。
- 4、二级市场交易代码：512660。
- 5、基金申购、赎回简称：军工 ETF。
- 6、申购、赎回代码：512661。
- 7、2016 年 8 月 1 日基金份额总额：589,079,995.00 份（未经份额折算）。
- 8、2016 年 8 月 1 日基金份额净值：0.9885 元（未经份额折算）。
- 9、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
- 10、上市交易日期：2016 年 8 月 8 日。

11、基金管理人：国泰基金管理有限公司。

12、基金托管人：中国建设银行股份有限公司。

13、上市推荐人：申万宏源证券有限公司。

14、申购赎回代理券商（以下简称“一级交易商”）：安信证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、长江证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司。

若有新增本基金的申购、赎回代办券商，本公司将另行公告。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的注册机构和注册文号：中国证券监督管理委员会证监许可【2016】733号文。

2、基金运作方式：交易型开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期：本基金自2016年6月20日至2016年7月18日公开发售。其中，网下现金认购和网下股票认购的日期为2016年6月20日至2016年7月18日，网上现金认购的日期为2016年7月14日至2016年7月18日。

5、发售价格：1.00元人民币。

6、发售期限：网下现金和网下股票发售21个工作日，网上现金发售3个工作日。

7、发售方式：投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。

8、发售机构

（1）直销机构

投资人可通过本基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金认购。

（2）代销机构

本基金的网下现金发售和网下股票发售代理机构为海通证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、万联证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、申万宏源西部证券有限公司、安信证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、国信证券股份有限公司。

本基金网上现金发售通过具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司进行。

（二）基金合同生效

本基金自 2016 年 6 月 20 日起向社会公开募集，截至 2016 年 7 月 18 日募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，此次募集的有效净认购金额为人民币 589,079,675.00 元（含所募集股票市值），通过网下直销现金认购的有效净认购资金在募集期间产生的银行利息共计 320.00 元人民币。本次募集认购资金及其产生的利息已于 2016 年 7 月 22 日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的基金托管专户，所募集股票已于 2016 年 7 月 22 日前过户至基金托管人和本基金以联名方式开立在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司的证券账户。

本次募集有效认购户数为 7,002 户，按照每份基金份额 1.00 元人民币计算，募集期间募集（含所募集股票市值）及利息结转的基金份额共计 589,079,995.00 份，已全部计入基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。

根据《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》以及《国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2016 年 7 月 26 日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

（三）基金上市交易

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书【2016】195 号。

2、上市交易日期：2016 年 8 月 8 日。

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

4、基金二级市场交易简称：军工 ETF。

5、二级市场交易代码：512660。投资人在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。

6、基金申购、赎回简称：军工 ETF。

7、申购、赎回代码：512661。投资人应当在本基金指定的一级交易商办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。目前本基金的一级交易商包括：安信证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、长江证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券股份有限公司。若有新增本基金的申购、赎回代办券商，本公司将另行公告。

8、本次上市交易份额：589,079,995.00 份（未经份额折算）。

9、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至 2016 年 8 月 1 日，本基金基金份额持有人户数为 7,002 户，平均每户持有的基金份额为 84,130.25 份。

（二）持有人结构

截至 2016 年 8 月 1 日，本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的基金份额为 23,527,434.00 份，占基金总份额的 3.99%；个人投资者持有的基金份额为 565,552,561.00 份，占基金总份额的 96.01%。

（三）前十名基金份额持有人的情况

截至 2016 年 8 月 1 日，前十名基金份额持有人的情况如下表（未经份额折算）：

序号	基金份额持有人名称(全称)	持有基金份额（份）	占基金总份额的比例（%）
1	唐春山	15,000,000.00	2.55
2	陈增贤	10,050,000.00	1.71
3	徐文功	10,000,000.00	1.70
4	都邦财产保险股份有限公司—传统保险产品	10,000,000.00	1.70
5	陈蓉微	6,000,000.00	1.02
6	王欢仙	5,560,000.00	0.94
7	何海波	5,001,000.00	0.85
8	杨景麟	4,990,000.00	0.85
9	李五玲	4,000,000.00	0.68
10	华宝证券有限责任公司	3,999,320.00	0.68

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

- 1、名称：国泰基金管理有限公司
- 2、法定代表人：唐建光
- 3、总经理：周向勇
- 4、注册资本：壹亿壹仟万元人民币
- 5、注册地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 39 楼
- 6、批准设立机关及设立批准文号：中国证监会证监基字【1998】5 号

7、工商登记注册的营业执照统一社会信用代码：91310000631834917Y

8、经营范围：基金设立、基金业务管理，及中国证监会批准的其他业务。

9、股权结构

股东名称	持股比例
中国建银投资有限责任公司	60%
意大利忠利集团	30%
中国电力财务有限公司	10%

10、内部组织结构及职能

公司建立并完善了科学的治理结构，目前有独立董事 4 名。董事会下设提名及资格审查委员会、薪酬委员会、考核委员会等专业委员会，对公司重大经营决策和发展规划进行决策及监督；

在组织结构方面，公司设立的分管领导议事会议、执行委员会会议、投资决策委员会、风险控制委员会等机构分别负责公司经营、基金投资和风险控制等方面的决策和监督控制。同时公司各部门之间有明确的授权分工和风险控制责任，既相互独立，又相互合作和制约，形成了合理的组织结构、决策授权和风险控制体系；

公司一贯坚持诚信为投资人服务的道德观和稳健经营的管理理念。在员工中加强职业道德教育和风险观念，形成了诚信为本和稳健经营的企业文化；

公司稽核监察部拥有对公司任何经营活动进行独立监察稽核的权限，并对公司内部控制措施的实施情况和有效性进行评价和提出改进建议。

11、人员情况

截至 2016 年 6 月 30 日，公司正式员工 246 人，其中 58%（143 人）的员工具有硕士及以上学历。

12、信息披露负责人：李永梅

咨询电话：400-888-8688

13、基金管理业务情况

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 62 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长混合型证券投资基金（原国泰金鹰增长证券投资基金）、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、

国泰金龙债券证券投资基金)、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金(由金鼎证券投资基金转型而来)、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金(原国泰金牛创新成长股票型证券投资基金)、国泰沪深 300 指数证券投资基金(由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来)、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金(原国泰区位优势股票型证券投资基金)、国泰中小盘成长混合型证券投资基金(LOF)(原国泰中小盘成长股票型证券投资基金(LOF),由金盛证券投资基金转型而来)、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典混合型证券投资基金(LOF)(原国泰价值经典股票型证券投资基金(LOF))、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金(原国泰事件驱动策略股票型证券投资基金)、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金(原国泰成长优选股票型证券投资基金)、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰信用债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基金(由金泰证券投资基金转型而来)、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰中证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势混合型证券投资基金(LOF)(原国泰估值优势股票型证券投资基金(LOF),由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来)、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰中证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金(由金鑫证券投资基金转型而来)、国泰新经济灵活配置混合

型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰创利债券型证券投资基金（由国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金转型而来）、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰生益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金（由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰新目标收益保本混合型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰鑫保本混合型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰民福保本混合型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，成为目前业内少数拥有“全牌照”的基金公司之一，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

14、本基金基金经理

艾小军，硕士研究生，15 年证券基金从业经验。2001 年 5 月至 2006 年 9 月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006 年 9 月至 2007 年 8 月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007 年 9 月至 2007 年 10 月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007 年 10 月加入国泰基金管理有限公司，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2015 年 3 月起兼任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 4 月起兼任国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理，2016 年 4 月起兼任国泰黄金交易型开

放式证券投资基金联接基金的基金经理，2016 年 7 月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

（二）基金托管人情况

- 1、名称：中国建设银行股份有限公司
- 2、住所：北京市西城区金融大街 25 号
- 3、办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
- 4、法定代表人：王洪章
- 5、成立时间：2004 年 9 月 17 日
- 6、批准设立机关和批准设立文号：中国银行业监督管理委员会银监复【2004】

143 号

- 7、组织形式：股份有限公司
- 8、注册资本：人民币贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
- 9、存续期间：持续经营
- 10、基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字【1998】12 号
- 11、联系人：田青
- 12、联系电话：010-67595096
- 13、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2015 年 9 月末，中国建设银行已托管 537 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自 2009 年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

14、主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金上市推荐人

申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

（四）验资机构

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

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：许康玮、胡逸嵘

联系人：胡逸嵘

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

本基金截至 2016 年 8 月 1 日的资产负债表如下：

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

资产	本期末 2016 年 8 月 1 日
资产：	
银行存款	481,462,038.88
结算备付金	
存出保证金	
交易性金融资产	100,714,369.00
其中：股票投资	100,714,369.00
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-

应收证券清算款	
应收利息	114,901.03
应收股利	-
应收申购款	
其他资产	108,605.66
资产总计	582,399,914.57
负债与持有人权益	
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	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	
应付管理人报酬	48,080.33
应付托管费	9,616.07
应付销售服务费	-
应付交易费用	49,422.23
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
预提费用	10,301.90
其他负债	2,884.82
负债合计	120,305.35
所有者权益：	
实收基金	589,079,995.00
未分配利润	-6,800,385.78
所有者权益合计	582,279,609.22

负债和所有者权益总计	582,399,914.57
------------	----------------

注：报告截止日 2016 年 8 月 1 日，军工 ETF 净值：0.9885 元，军工 ETF 份额总额：589,079,995.00 份。

八、基金投资组合

截至2016年8月1日，国泰中证军工ETF的投资组合如下：

（一）报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	100,714,369.00	17.29
	其中：股票	100,714,369.00	17.29
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	481,462,038.88	82.67
6	其他各项资产	223,506.69	0.04
7	合计	582,399,914.57	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

2、报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业		
C	制造业	95,768,206.00	16.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	912,543.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,699,180.00	0.64
J	金融业	-	-
K	房地产业		
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	334,440.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合		
	合计	100,714,369.00	17.30

(三) 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

1、期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601989	中国重工	1,547,900	10,045,871.00	1.73%
2	000901	航天科技	229,100	8,174,288.00	1.40%
3	300065	海兰信	159,900	5,692,440.00	0.98%
4	000738	中航动控	221,000	5,675,280.00	0.97%

5	000768	中航飞机	262,700	5,585,002.00	0.96%
6	600893	中航动力	148,000	5,138,560.00	0.88%
7	600038	中直股份	107,900	4,341,896.00	0.75%
8	002413	雷科防务	260,000	3,640,000.00	0.63%
9	600879	航天电子	218,300	3,440,408.00	0.59%
10	002519	银河电子	155,300	3,220,922.00	0.55%

2、期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

（五）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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

（六）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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

（八）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

（九）投资组合报告附注

1、本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

2、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情况。

3、其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
----	----	-------

1	存出保证金	
2	应收证券清算款	
3	应收股利	-
4	应收利息	114,901.03
5	应收申购款	
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	108,605.66
9	合计	223,506.69

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

5、期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

（1）期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

（2）期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

九、重大事项揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：

（一）严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监

督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

（二）根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查；如发现基金管理人违反法律法规、本基金《基金合同》和《托管协议》的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

（三）基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，将及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人就基金上市交易事宜出具意见如下：

（一）本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件；

（二）基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

十三、备查文件目录

（一）中国证监会准予国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；

（二）《国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

（三）《国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

（四）《国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

（五）法律意见书；

（六）基金管理人业务资格批件和营业执照；

（七）基金托管人业务资格批件和营业执照。

存放地点：基金管理人和基金托管人处。

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

风险提示：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，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

国泰基金管理有限公司

二〇一六年八月三日

附件：基金合同摘要

一、基金管理人、基金托管人、基金份额持有人的权利、义务

1、基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 自行担任注册登记机构或/或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构，办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、转融通证券出借；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律法规和相关证券交易所及注册登记机构相关业务规则的规定以及本基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回等业务的规则；

(17) 在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和注册登记手续；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回对价，编制申购赎回清单；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回对价；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上，法律法规另有规定的从其规定；

(17) 确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资人能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能

生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

- (25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (26) 按规定建立、保存并向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
- (27) 依照法律法规为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (28) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

3、基金托管人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

- (1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；
- (2) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；
- (3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资人的利益；
- (4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、资金账户等投资所需账户，为基金办理证券交易资金清算；
- (5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；
- (6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- (7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

4、基金托管人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的

基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

（4）除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值；

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上，法律法规另有规定的从其规定；

（12）建立并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（14）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价；

（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

（19）因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿

责任不因其退任而免除；

（20）按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

5、基金份额持有人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法申请赎回或转让其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（7）监督基金管理人的投资运作；

（8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

（9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

6、基金份额持有人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

（1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；

（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（4）缴纳基金认购、申购和赎回对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用；

(5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

在本基金成功募集并运作之后，如基金管理人管理本基金的联接基金的：

鉴于本基金和本基金的联接基金（即“国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金联接基金”以及基金管理人根据基金发展需要募集并管理的以本基金为目标 ETF 的其他联接基金，以下简称“联接基金”）的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金份额出席或者委派代表出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金份额持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的，须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议

召开或召集本基金份额持有人大会。

1、召开事由

（1）当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会（法律法规、《基金合同》或中国证监会另有规定的除外）：

- 1）终止《基金合同》；
- 2）更换基金管理人；
- 3）更换基金托管人；
- 4）转换基金运作方式；
- 5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 6）变更基金类别；
- 7）本基金与其他基金的合并；
- 8）变更基金投资目标、范围或策略；
- 9）变更基金份额持有人大会程序；
- 10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

- 12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

13）终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的情形除外；

14）法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

（2）以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- 1）调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金财产承担的费用；
- 2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

3）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下变更收费方式；

4) 因相应的法律法规、上海证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

5) 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，增加或减少份额类别，或调整基金份额分类办法及规则；

6) 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人经与基金托管人协商一致，调整基金收益的分配原则和支付方式；

7) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

8) 在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人、相关证券交易所、注册登记机构、销售机构调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户等业务的规则；

9) 按照基金合同的约定，变更本基金的标的指数，调整业绩比较基准；

10) 在法律法规规定或中国证监会许可的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下基金推出新业务或服务；

11) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、召集方式

(1) 除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

(3) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

(4) 代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份

额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

（5）代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

（6）基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

3、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指

定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

4、开会方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式或法律法规或监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

（1）现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符；

2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

（2）通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管

人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

4）上述第3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金注册登记机构记录相符。

（3）在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会，具体方式在会议通知中列明。

（4）在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。表决方式上，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中载明。

5、议事内容与程序

（1）议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应

当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

（2）议事程序

1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

（2）特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并，以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时监督员及公证机关均认为有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认基金份额持有人身份文件的表决视为有效出席的基金份额持有人，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

7、计票

（1）现场开会

1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代

表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

8、生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

9、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金收益分配原则、执行方式

1、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

2、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

3、基金收益分配原则

（1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，每年收益分配次数最多为 12 次，具体分配方案以公告为准。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

（2）本基金的收益分配方式为现金分红；

（3）基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上，可进行收益分配；

(4) 本基金收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

(5) 每一基金份额享有同等分配权；

(6) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介上公告。

4、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

5、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

6、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

1、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) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

(5) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；

(6) 基金份额持有人大会费用；

(7) 基金的证券交易费用；

(8) 基金的银行汇划费用；

(9) 基金上市费及年费；

(10) 基金的开户费用、账户维护费用；

(11) 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。

2、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 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，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 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(3) 基金合同生效后的指数许可使用费

本基金的标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

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

标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元（基金合同生效日所在季度除外），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

标的指数许可使用费每日计算，逐日累计，按季支付。标的指数许可使用费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于次季度前 10 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

基金管理人可根据指数使用许可协议，对上述计提标准和计提方式进行合理变更，此项变更无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒介进行公告。

上述“1、基金费用的种类中第（4）—（11）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。

3、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。

4、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。

五、基金财产的投资方向和投资限制

1、投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

2、投资范围

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券等）、债券回购、资产支持证券、银行存款等固定收益类品种、权证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

中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,本基金可将其纳入投资范围,其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。

基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%且不低于基金资产净值的90%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。

3、投资限制

(1) 组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

1) 基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%且不低于基金资产净值的90%;

2) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

3) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;

6) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

7) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

9) 本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

10) 基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

11) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金

资产净值的40%；债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

12) 本基金资产总值不超过基金资产净值的140%；

13) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资；

14) 本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%；

15) 本基金参与转融通证券出借交易的，每个交易日日终，本基金参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的50%，证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定时，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，基金的投资范围、投资策略应符合基金合同的约定。基金托管人对基金投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

(2) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- 1) 承销证券；
- 2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- 3) 从事承担无限责任的投资；
- 4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- 5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资

不再受相关限制。

（3）关联交易

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

2、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

3、基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售机构以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

1、《基金合同》的变更

（1）变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公

告，并报中国证监会备案。

(2) 关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后 2 个工作日内在指定媒介公告。

2、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

(1) 基金份额持有人大会决定终止的；

(2) 基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

(3) 《基金合同》约定的其他情形；

(4) 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

3、基金财产的清算

(1) 基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

(4) 基金财产清算程序：

1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

3) 对基金财产进行估值和变现；

4) 制作清算报告；

5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

7) 对基金剩余财产进行分配。

(5) 基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限

制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

5、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上，法律法规另有规定的从其规定。

八、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，应经友好协商解决，如经友好协商未能解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京市的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。