富国中证军工指数分级证券投资基金之军工A与军工B基金份额上市交易公告书

基金管理人:富国基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2014年4月23日
公告日期:2014年4月18日

一、重要声明与提示

《富国中证军工指数分级证券投资基金之军工A与军工B基金份额上市交易公告书》(以下简称“本公告”)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《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,富国中证军工指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)管理人富国基金管理有限公司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。

中国证监会、深圳证券交易所对富国中证军工指数分级证券投资基金之军工A与军工B基金份额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,请投资者详细查阅刊登在2014年3月12日《中国证券报》和《上海证券报》以及富国基金管理有限公司网站(www.fullgoal.com.cn)上的《富国中证军工指数分级证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称:富国中证军工指数分级证券投资基金
2、基金类别:股票型
3、基金运作方式:契约型开放式
4、本基金的基金份额包括富国中证军工指数分级证券投资基金之基础份额(即“富国军工份额”,场内简称“富国军工”,基金代码:161024)、富国中证军工指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(即“富国军工A份额”,场内简称“军工A”,基金代码:150181)与富国中证军工指数分级证券投资基金之积极收益类份额(即“富国军工B份额”,场内简称“军工B”,基金代码:150182)。
5、基金存续期限:不定期。
6、富国军工A份额、富国军工B份额与富国军工份额的资产合并运作。
7、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。投资者场外认购所得的份额,将被确认为富国军工份额。投资者场内认购所得的份额,将按1∶1的基金份额配比自动分拆为富国军工份额A份额和富国军工份额B份额。基金合同生效后,投资者认购所得的富国军工份额场内份额的分拆,由基金管理人委托注册登记机构进行,无需基金份额持有人申请。
8、基金合同生效后,富国军工份额(场内简称:富国军工,基金代码:161024)设置单独的基金代码,只可以进行场内与场外的申购和赎回,不上市交易。富国军工A份额(场内简称:军工A;交易代码:150181)与富国军工B份额(场内简称:军工B;交易代码:150182)只可在深圳证券交易所上市交易,不可单独进行申购或赎回。
9、富国军工份额的申购与赎回:投资者可通过场外或场内两种方式,申购或赎回富国军工份额(场内简称:富国军工,基金代码:161024)。办理富国军工份额场内申购、赎回业务的代销机构为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。办理富国军工份额场外申购、赎回业务的机构为直销机构和场外代销机构。本基金不对富国军工A份额或富国军工B份额单独开放场内申购、赎回。
10、场内份额配对转换:场内份额配对转换是指本基金场内的富国军工份额与分级份额之间进行转换的行为,包括分拆与合并。分拆指场内的富国军工份额按照1∶1的基金份额配比分拆成军工A份额和军工B份额的行为。合并指军工A份额和军工B份额按照1∶1的基金份额配比合并成富国军工份额场内份额的行为。
11、基金份额折算:基金份额定期折算的频率为每年折算1次。基金份额不定期折算的条件是富国军工份额的基金份额净值高至1.500元或以上,或富国军工B份额的基金份额参考净值低至0.250元或以下。有关基金份额折算的约定,参见基金合同“二十一、基金份额折算”。定期折算基准日或不定期折算基准日的具体日期,详见基金管理人届时发布的公告。
12、基金份额总额:截至2014年4月16日,本基金的份额总额为981,730,575.51份;其中,富国军工份额为769,456,933.51份;军工A份额为106,136,821份;军工B份额为106,136,821份。
13、基金份额净值:截至2014年4月16日,富国军工份额的基金份额净值为1.00元,军工A份额的基金份额净值为1.002元,军工B份额的基金份额净值为0.998元。
14、本次上市交易的基金份额简称及交易代码:份额简称:军工A,交易代码:150181 份额简称:军工B,交易代码:150182
15、本次上市交易份额 军工A:106,136,821份 军工B:106,136,821份
16、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
17、上市交易日期:2014年4月23日
18、基金管理人:富国基金管理有限公司
19、基金托管人:中国建设银行股份有限公司
20、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

三、富国中证军工指数分级证券投资基金的募集与上市交易

(一)富国中证军工指数分级证券投资基金上市前募集情况
1、本基金发售申请的核准机构和核准文号:中国证监会证监许可[2014]236号
2、发售日期:2014年3月17日至2014年3月31日
3、发售面值:1.00元人民币
4、发售方式:场内、场外认购
5、发售机构:
(1)场内发售机构
场内销售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。
(2)场外发售机构
本基金的场外销售机构包括直销机构和代销机构。其中直销机构是指富国基金管理有限公司(以下简称“本公司”),包括上海投资理财中心、代销机构是指中国建设银行股份有限公司、中银万国证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、华西证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、长城证券有限责任公司、广发证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、渤海证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、中航证券有限公司、天相投资顾问有限公司、招商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、宏源证券股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、海通证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、方正证券股份有限公司、上海好买基金销售有限公司(排名不分先后)。
6、验资机构名称:安永华明会计师事务所有限责任公司
7、认购资金总额及入账情况:
本次富国中证军工指数分级证券投资基金募集的有效认购户数为9,152户,净销售金额为人民币981,504,275.11元,认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币226,300.40元。
上述资金中,场内首次发行募集基金为人民币212,273,642元,场外首次发行募集基金为人民币769,456,933.51元,分别于2014年4月4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富国中证军工指数分级证券投资基金托管专户。
按照每份基金份额初始面值1.00元计算,本次募集期的募集资金及其利息结转的份额共计981,730,575.51份,已全部计入基金份额持有人基金账户,归基金份额持有人所有。
8、基金备案情况
本基金于2014年4月4日验资完毕,2014年4月4日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于2014年4月4日获得书面确认,本基金基金合同自该日起正式生效。
9、基金合同生效日:2014年4月4日。
10、本基金总份额:981,730,575.51份。
(二)富国中证军工指数分级证券投资基金基金份额上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上[2014]136号
2、上市交易日期:2014年4月23日
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
4、份额简称:军工A,交易代码:150181 份额简称:军工B,交易代码:150182
6、本次上市交易份额:军工A:106,136,821份 军工B:106,136,821份(截至2014年4月16日)
7、基金资产净值的披露:每个工作日的次日公布富国中证军工指数分级证券投资基金、军工A、军工B的基金份额净值,并在深交所行情发布系统揭示。
8、未上市交易份额的流通规定:未上市交易的份额托管在场外,基金份额持有人将其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

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2014年4月16日,富国中证军工指数分级证券投资基金之富国军工份额的持有人总户数为7745户,全部为场外持有人;富国军工A份额持有人总户数为1407户,全部为场内持有人;富国军工B份额持有人总户数为1407户,全部为场内持有人;富国军工份额平均每户持有的场外基金份额为99348.86份,军工A平均每户持有的场内基金份额为75434.84份,军工B平均每户持有的场内基金份额为75434.84份。
(二)持有人结构
截至2014年4月16日,场内基金份额持有人结构如下:
军工A:场内机构投资者持有的基金份额5351087份,占比5.04%;场内个人投资者持有的基金份额100785734份,占比94.96%。
军工B:场内机构投资者持有的基金份额5351086份,占比5.04%;场内个人投资者持有的基金份额100785735份,占比94.96%。
(三)截至2014年4月16日,场内军工A基金份额前十名持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占场内基金总份额的比例(%)
1	林年龙	7,220,693	6.80%
2	湖州嘉欣置业有限公司	2,500,413	2.36%
3	陈丽娟	1,996,330	1.88%
4	广州万宝长春投资有限公司	1,025,070	0.97%
5	严高林	1,000,165	0.94%
6	陈光武	1,000,165	0.94%
7	商鸣毅	1,000,165	0.94%
8	崔书华	1,000,165	0.94%
9	国民信托有限公司—国民赣和1号证券投资集合资金信托计划	1,000,029	0.94%
10	陈雯	996,077	0.94%

截至2014年4月16日,场内军工B基金份额前十名持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占场内基金总份额的比例(%)
1	林年龙	7,220,693	6.80%
2	湖州嘉欣置业有限公司	2,500,413	2.36%
3	陈丽娟	1,996,329	1.88%
4	广州万宝长春投资有限公司	1,025,069	0.97%
5	严高林	1,000,165	0.94%
6	陈光武	1,000,165	0.94%
7	商鸣毅	1,000,165	0.94%
8	崔书华	1,000,165	0.94%
9	国民信托有限公司—国民赣和1号证券投资集合资金信托计划	1,000,029	0.94%
10	陈雯	996,077	0.94%

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1、基本情况
名称:富国基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期16-17层
法定代表人:陈敏
总经理:陈戈
成立日期:1999年4月13日
电话:(021)20361818
传真:(021)20361616
联系人:范伟隽
注册资本:1.8亿元人民币
股权结构(截止于2014年4月16日):

股东名称	出资比例(%)
海通证券股份有限公司	27.775%
中银万国证券股份有限公司	27.775%
加拿大蒙特利尔银行	27.775%
山东省国际信托有限公司	16.675%

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责制定基金投资的重大决策和投资风险管理。风险控制委员会负责公司日常运作的风险控制和管理工作,确保公司日常经营活动符合相关法律法规和行业监管规则,防范和化解运作风险、合规与道德风险。
公司目前下设十九个部门、三个分公司和二个子公司,分别是:权益投资部、固定收益投资部、量化与海外投资部、权益专户投资部、养老金投资部、权益研究部、集中交易部、机构业务部、零售业务部、营销管理部、客户服务部、电子商务部、战略与产品部、监察稽核部、计划财务部、人力资源部、行政管理部、信息技术部、运营部、北京分公司、成都分公司、广州分公司、富国资产管理(香港)有限公司、富国资产管理(上海)有限公司。权益投资部:负责权益类基金产品的投资管理;固定收益投资部:负责固定收益类公募产品和非固定收益类公募产品的债券部分(包括公司自有资金等)的投资管理;量化与海外投资部:负责量化权益投资、量化衍生品投资及境外权益等各类投资的研究与投资管理;权益专户投资部:负责社保、保险、QFII、一对一、一对多等非公募权益类专户的投资管理;养老金投资部:负责养老金(企业年金、职业年金、基本养老金、社保等)及类养老金专户等产品的投资管理;权益研究部:负责行业研究、上市公司研究和宏观研究等;集中交易部:负责投资交易和风险控制;机构业务部:负责年金、专户、社保以及共同基金的机构客户营销工作;零售业务部:管理华东营销中心、华中营销中心、华南营销中心(广州分公司)、北方营销中心(北京分公司)、西部营销中心(成都分公司)、华北营销中心,负责共同基金的零售业务;营销管理部:负责营销计划的拟定和落实、品牌建设和媒体关系管理,为零售和机构业务团队、子公司等提供一站式销售支持;客户服务部:拟定客户服务策略,制定客户服务规范,建设客户服务团队,提高客户满意度,收集客户信息,分析客户需求,支持公司决策;电子商务部:负责基金电子商务发展趋势分析,拟定并落实公司电子商务发展策略和实施细则,有效推进公司电子商务业务;战略与产品部:负责开发、维护公募和非公募产品,协助管理层研究、制定、落实、调整公司发展战略,建立数据搜集、分析平台,为公司投资决策、销售决策、业务发展、绩效分析等提供整合的数据支持;监察稽核部:负责监察、风控、法务和信息披露;信息技术部:负责软件开发与系统维护等;运营部:负责基金会计与清算;计划财务部:负责公司财务计划与管理;人力资源部:负责人力资源规划与管理;行政管理部:负责文秘、行政后勤;富国资产管理(香港)有限公司:就证券提供意见和提供资产管理;富国资产管理(上海)有限公司:经营特定客户资产管理以及中国证监会认可的其他业务。
截止到2014年4月16日,公司有员工235人,其中62%以上具有硕士以上学历。
3、本基金基金经理
王保合先生,1977年出生,博士。自2006年7月开始从事证券行业工作。曾任富国基金管理有限公司研究员;富国沪深300增强证券投资基金基金经理助理;2011年3月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2013年9月起任富国创业板指数分级证券投资基金基金经理,2014年4月起任富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理。兼任富国基金管理有限公司量化投资副总监。
章根元先生,1982年出生,硕士。自2008年7月至2011年5月在建信基金管理有限责任公司任研究员助理、初级研究员、研究员;自2011年5月至2013年12月在富国基金管理有限公司任基金经理助理,自2013年12月起任富国创业板指数分级证券投资基金基金经理,2014年4月起任富国中证军工指数分级证券投资基金基金经理。
(二)基金托管人
1. 基本情况
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田青
联系电话:(010) 6759 5096
中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史,其前身“中国人民建设银行”于1954年成立,1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数,2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。
截至2013年6月30日,中国建设银行资产总额148,592.14亿元,较上年末增长6.34%。2013年上半年,中国建设银行实现净利润1,199.64亿元,较上年同期增长12.65%。年化资产回报率为1.66%,年化加权净资产收益率为23.90%。利息净收入1,876.60亿元,较上年同期增长10.59%。净利差为2.54%,较上年同期提高0.01个百分点。净利息收益率为2.71%,与上年同期持平。手续费及佣金净收入555.24亿元,较上年同期增长12.76%。
中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、台北设有10家一级海外分行,拥有建行亚洲、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建银国际等5家全资子公司,海外机构已覆盖到全球14个国家和地区,基本完成在全球主要金融中心的网络布局,24小时不间断服务能力和基本服务架构已初步形成。中国建设银行筹建、设立村镇银行27家,拥有建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿、中德住房储蓄银行等多家子公司,为客户提供一体化全面金融服务能力进一步增强。
2013年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与社会各界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的近30个重要奖项。在英国《银行家》杂志2013年“世界银行1000强排名”中位列第5,较上年上升1位;在美国《财富》世界500强排名第50位,较上年上升27位;在美国《福布斯》2013年全球2000强上市企业排行榜中位列全球第2,较上年提升11位。此外,本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、投资者关系和企业社会责任等领域的多个专项奖。
中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、核算处、清算处、监督稽核处、涉外资产核算团队、养老金托管处、托管业务系统规划与管理团队、上海备份中心等12个职能处室、团队,现有员工225人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。
2. 主要人员情况
杨新丰,投资托管业务部总经理,曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部,长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大客户的客户管理及服务工作,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。
郑绍平,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
3. 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2013年6月30日,中国建设银行已托管311只证券投资基金。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。中国建设银行在2005年及自2009年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”,在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”奖,并获和讯网2011年度和2012年度中国“最佳资产托管银行”奖,和瑞内权威经济媒体《每日经济观察》2012年度“最佳基金托管银行”奖。
(三)基金验资机构
名称:安永华明会计师事务所有限责任公司
注册地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼
法定代表人:葛明
联系电话:021-22288888
传真:021-22280000
联系人:徐艳
经办注册会计师:徐艳、蒋燕华

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。
本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
富国中证军工指数分级证券投资基金2014年4月16日资产负债表如下:
(除特别注明外,金额单位为人民币元)

资 产	本期末2014年4月16日
资 产:	
银行存款	81,998,901.75
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	86,575,215.46
其中:股票投资	86,575,215.46
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	853,438,638.15
应收利息	182,092.05
应收股利	-
应收申购款	-
其他资产	
资产合计:	1,022,194,847.41
负债和所有者权益	
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	39,763,910.84
应付赎回款	
应付管理人报酬	322,760.37
应付托管费	71,007.29
应付销售服务费	
应付交易费用	77,641.50
应付税费	
应付利息	
应付利润	
其他负债	18,881.65
负债合计	40,254,201.65
所有者权益:	
实收基金	981,730,575.51
未分配利润	210,070.25
所有者权益合计	981,940,645.76
负债与持有人权益总计:	1022194847.41

八、基金投资组合

截至2014年4月16日,富国中证军工指数分级证券投资基金的投资组合如下:
(一)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	86,575,215.46	8.47
	其中:股票	86,575,215.46	8.47
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	81,998,901.75	8.02
6	其他资产	853,620,730.20	83.51
7	合计	1,022,194,847.41	100

(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:截至2014年4月16日,本基金未持有积极投资股票。
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	80,399,126.46	8.19
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	1,156,620.00	0.12
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	5,019,469.00	0.51
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		
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	86,575,215.46	8.82

(三)报告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、报告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	1,390,500	6,632,685.00	0.68%
2	768	中航飞机	478,600	4,269,112.00	0.43%
3	600271	航天信息	199,700	4,013,970.00	0.41%
4	300024	机器人	74,700	3,886,641.00	0.40%
5	600118	中国卫星	211,600	3,679,724.00	0.37%
6	600150	中国船舶	189,651	3,662,160.81	0.37%
7	2465	海格通信	166,700	3,415,683.00	0.35%
8	600879	航天电子	293,800	3,275,870.00	0.33%
9	600316	洪都航空	157,300	2,601,742.00	0.27%
10	600372	中航电子	124,600	2,565,514.00	0.26%

2、报告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:截至2014年4月16日,本基金未持有积极投资股票。
(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:截至2014年4月16日,本基金不报告期末未持有债券。
(五)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债券投资明细
注:截至2014年4月16日,本基金未持有债券。
(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
注:截至2014年4月16日,本基金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:截至2014年4月16日,本基金未持有权证。
(八)投资组合报告附注
1、申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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、处罚的情况。
截至2014年4月16日,本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。
2、申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。
截至2014年4月16日,本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。
3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	853,438,638.15
3	应收股利	-
4	应收利息	182,092.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	853,620,730.20

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:截至2014年4月16日,本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5、报告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:截至2014年4月16日,本基金持有的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:截至2014年4月16日,本基金未持有积极投资股票。

九、重大事件揭示

本基金自基金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

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:
(一)严格遵守《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、深圳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》、《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》、《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、基金份额净值计算进行监督和核查。如发现基金管理人违反《基金法》、《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,将及时通知基金管理人纠正;基金管理人对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。

十二、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅。
(一)中国证监会核准基金募集的文件
(二)《富国中证军工指数分级证券投资基金基金合同》
(三)《富国中证军工指数分级证券投资基金招募说明书》
(四)《富国中证军工指数分级证券投资基金托管协议》
(五)法律意见书
(六)基金管理人业务资格批件、营业执照
(七)基金托管人业务资格批件、营业执照
附件:基金合同内容摘要
(一)基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务
1. 基金份额持有人的权利、义务
富国军工A份额、富国军工B份额、富国军工份额持有人持有的每一份基金份额按基金合同约定仅在其份额类别内拥有同等的权益。
(1)根据《基金法》及其他有关法律法规,基金份额持有人的权利为:
a.分享基金财产收益;
b.参与分配清算后的剩余基金财产;
c.依法转让其持有的本基金上市交易份额,依法申请赎回其持有的富国军工份额;
d.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;
e.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;
f.查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
g.监督基金管理人的投资运作;
h.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;
i.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他权利。
(2)根据《基金法》及其他有关法律法规,基金份额持有人的义务为:
a.遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;
b.交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用;
c.在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;
d.不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动;
e.执行生效的基金份额持有人大会决议;
f.返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;
g.认真阅读并遵守《基金合同》;
h.了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自行承担投资风险;
i.关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;
j.法律法规和基金合同规定的其他义务。
2. 基金管理人的权利、义务
(1)根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的权利为:
a.自本基金合同生效之日起,依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产;
b.依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;
c.销售基金份额;
d.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;
e.在符合有关法律法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管等业务的规则,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;
f.根据本基金合同及有关规定监督基金托管人,对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;
g.在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回申请;
h.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、融券;
i.自行担任或选择、更换注册登记机构,获取基金份额持有人名册,并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;
j.选择、更换销售机构,对其行为进行监督和检查;
k.选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
l.在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
m.依法召集基金份额持有人大会;
n.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;
o.依法募集资金;
p.依照《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;
q.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他权利。
(2)根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的义务为:
a.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、赎回和登记事宜;
b.办理基金备案手续;
c.自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;
d.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;
e.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;
f.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得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;
g.依法接受基金托管人的监督;
h.计算并公告基金资产净值、基金份额净值,确定富国军工份额的基金份额净值和申购赎回价格、富国军工A份额和富国军工B份额的基金份额参考净值;
i.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;
j.按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
k.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
l.编制季度、半年度和年度基金报告;
m.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;
n.保守基金商业秘密,不得泄露基金投资计划、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,不得向他人泄露;
o.按照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收益;
p.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;
q.按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料15年以上;
r.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者实施其他法律行为;
s.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;
t.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,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
u.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,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
v.确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《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;
w.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;
x.执行生效的基金份额持有人大会决议;
y.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;
z.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,不谋求对上市公司的控股和直接管理;
aa.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;
bb.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;
cc.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。
3. 基金托管人的权利、义务
(1)根据《基金法》及其他有关法律法规,基金托管人的权利为:
a.依基金合同约定获得