富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

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:上海证券交易所
上市时间:2019年8月26日
公告日期:2019年8月21日

一、重要声明与提示

《富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》(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《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)基金管理人富国基金管理有限公司(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。

中国证监会、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,请投资者详细查阅2019年5月21日刊登在《中国证券报》及富国基金管理有限公司网站(www.fullgoal.com.cn)上的《富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称:富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金
2、基金二级市场交易简称:军工龙头
3、二级市场交易代码:512710
4、基金场内申购、赎回简称:军工龙头
5、场内申购、赎回代码:512711
6、截至公告日前两个工作日(2019年8月19日)基金份额总额:7,202,329,199.00份
7、截至公告日前两个工作日(2019年8月19日)基金份额净值:1.0028元
8、本次上市交易份额:7,202,329,199.00份
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:2019年8月26日
11、基金管理人:富国基金管理有限公司
12、基金托管人:中国建设银行股份有限公司
13、申购赎回代理券商(以下简称“一级交易商”):长江证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、湘财证券股份有限公司、中航证券有限公司、中国国际金融股份有限公司、招商证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司。

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、基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会2019年4月22日证监许可(2019)808号。
2、基金运作方式:契约型、交易型开放式。
3、基金合同期限:不定期。
4、发售日期:2019年5月24日至2019年7月11日。其中,网下现金认购的日期为2019年5月24日至2019年7月11日;网上现金认购的日期为2019年7月9日至2019年7月11日;网下股票认购的日期为2019年5月24日至2019年7月11日。
5、发售价格:人民币1.00元。
6、发售期限:网下现金认购和网下股票认购34个工作日,网上现金认购3个工作日。
7、发售方式: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)发售主协调人
中航证券有限公司。
(2)网下现金认购和网下股票认购的直销机构
富国基金管理有限公司。
(3)网下现金认购和网下股票认购的发售代理机构
海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、中航证券有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司。
(4)网上现金认购的发售代理机构
具有基金代销业务资格,并经上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司认可的证券公司(具体名单可在上海证券交易所网站查询)。
9、验资机构名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
10、募集资金总额及入账情况
此次募集扣除认购费后的有效净认购金额(不含利息)为7,202,327,716.00元人民币(含所募集股票市值),认购资金在募集期间产生的利息为659,148.09元人民币。
有效的现金净认购资金已于2019年7月17日划至本基金的托管账户。网下认购股票截至2019年7月22日已划转至本基金的证券账户,应归基金资产的利息将于下一个银行结息日(2019年9月20日)划入本基金的托管账户。
本次募集有效认购户数为30,369户,按照每份基金份额面值1.00元人民币计算,本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计7,202,329,199.00份,已全部计入各基金份额持有人的基金账户。
11、基金备案情况
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《富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金合同》、《富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》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基金备案手续,并于2019年7月23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。
12、基金合同生效日:2019年7月23日。
13、基金合同生效日的基金份额总额:7,202,329,199.00份
(二)本基金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:上海证券交易所自律监管决定书[2019]179号
2、上市交易日期:2019年8月26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:军工龙头
5、二级市场交易代码:512710
投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易
6、基金申购、赎回简称:军工龙头
7、申购、赎回代码:512711
本基金管理人自2019年8月26日开始办理本基金的申购和赎回业务。投资者应当在本基金指定的申购赎回代理券商的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。
目前本基金的申购赎回代理券商包括:长江证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、湘财证券股份有限公司、中航证券有限公司、中国国际金融股份有限公司、招商证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司。
本公司可适时增加或调整申购赎回代理券商,并及时公告。
8、本次上市交易份额:7,202,329,199.00份
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2019年8月19日,本基金场内份额持有人户数为30,369户,平均每户持有的基金份额为237,160.57份。
(二)持有人结构
截至2019年8月19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5,261,872,049.00份,占基金总份额的73.06%;个人投资者持有的基金份额为1,940,457,150.00份,占基金总份额的26.94%。
(三)前十名基金份额持有人的情况

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	中国航空工业集团有限公司	953,962,500.00	13.25%
2	中航投资控股有限公司	864,147,923.00	12.00%
3	汉中航空工业(集团)有限公司	769,726,950.00	10.69%
4	哈尔滨飞机工业集团有限责任公司	719,219,481.00	9.99%
5	中兵投资管理有限责任公司	512,475,940.00	7.12%
6	中国航空救生研究所	242,999,000.00	3.37%
7	中国贵州航空工业(集团)有限责任公司	208,236,000.00	2.89%
8	招商证券股份有限公司	200,026,247.00	2.78%
9	中国国际金融股份有限公司	150,000,000.00	2.08%
10	中国航空科技工业股份有限公司	130,252,505.00	1.81%

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司上海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、名称:富国基金管理有限公司
2、法定代表人:裴长江
3、总经理:陈戈
4、注册资本:5.2亿元人民币
5、注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期16-17楼
6、设立批准文号:证监基金字【1999】11号
7、工商登记注册的法人营业执照文号:310000400214240
8、经营范围:公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理
9、股权结构(截止于2019年7月31日):

股东名称	出资比例
海通证券股份有限公司	27.775%
申万宏源证券有限公司	27.775%
加拿大蒙特利尔银行	27.775%
山东省国际信托股份有限公司	16.675%

10、内部组织结构及职能:
公司目前下设二十八个部门、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、固定收益专户投资部、固定收益信用研究部、固定收益策略研究部、多元资产投资部、量化投资部、海外权益投资部、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、养老金业务部、银行业务部、机构服务部、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、合规稽核部、风险管理部、计划财务部、人力资源部、综合管理部(董事会办公室)、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;固定收益专户投资部:负责一对一、一对多等非公募固定收益类专户的投资管理;固定收益信用研究部:建立和完善债券信用评级体系,开展信用研究等,为公司固定收益类投资决策提供研究支持;固定收益策略研究部:开展固定收益投资策略研究,统一固定收益投资中台管理,为公司固定收益类投资决策和执行提供发展建议、研究支持和风险控制;多元资产投资部:根据法律法规、公司规章制度、契约要求,在授权范围内,负责FOF基金投资运作和跨资产、跨品种、跨策略的多元资产配置产品的投资管理;量化投资部:负责公司有关量化投资管理业务;海外权益投资部:负责公司在中国境外(含香港)的权益投资管理;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:负责投资交易风险控制;机构业务部:负责保险、财务公司、上市公司、主权财富基金、基金会、券商、信托、私募、同业养老金管理人、同业公募基金FOF、海外客户等客群的销售与服务;养老金业务部:负责养老金第一、第二支柱客户、共同参与第三支柱客户的销售与服务;银行业务部:负责银行客户的金融市场部、同业部、资产管理部、私人银行部等部门非代销销售与服务;机构服务部:负责协调三个机构销售部门对接公司资源,实现项目落地,提供专业支持和项目管理,对公司已有机构客户进行持续专业服务;零售业务部:管理华东营销中心、华中营销中心、广东营销中心、深圳营销中心、北京营销中心、东北营销中心、西部营销中心、华北营销中心,负责公募基金的零售业务;营销管理部:负责营销计划的拟定和落实、品牌建设和媒介关系管理,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;合规稽核部:履行合规审查、合规检查、合规咨询、反洗钱、合规宣导与培训、合规监测等合规管理职能,开展内部审计,管理信息披露、法律事务等;风险管理部:执行公司整体风险管理策略,牵头拟定公司风险管理制度与流程,组织开展风险识别、评估、报告、监测与应对,负责公司旗下各投资组合合规监控等;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;综合管理部(董事会办公室):负责公司董事会日常事务、公司文秘管理、公司(内部)宣传、信息调研、行政后勤管理等工作;富国资产管理(香港)有限公司:证券交易、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。
11、人员情况
截止到2019年7月31日,公司有员工464人,其中70%以上具有硕士以上学历。
12、信息披露负责人:赵瑛
电话:021-20361818
13、基金管理业务介绍
截至2019年6月30日,本公司旗下共管理137只开放式基金和多个全国社保基金资产组合、企业年金及特定客户资产管理业务,公募基金资产管理规模2630.68亿元。
14、本基金基金经理
王乐乐,博士,自2010年6月至2011年11月在上海证券有限责任公司任研究员;自2011年11月至2012年6月在华泰联合证券有限责任公司任研究员;自2012年7月至2015年5月在华泰证券股份有限公司历任研究员、创新规划团队负责人;自2015年5月加入富国基金管理有限公司,2015年8月起任富国中证煤炭指数分级证券投资基金基金经理,2016年10月至2018年7月任富国全球债券证券投资基金基金经理,2017年10月起任富国兴利增强债券型发起式证券投资基金基金经理,2017年11月起任富国中证工业4G指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金基金经理,2018年11月起任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2018年12月起任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2019年3月起任富国恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019年6月起任富国创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2019年7月起任富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理;兼量化投资部ETP投资总监。具有基金从业资格。
牛志冬,硕士,自2007年7月至2010年8月任华夏基金管理有限公司研究员;自2010年8月至2012年4月任富国基金管理有限公司基金经理助理;自2012年4月至2015年3月任富国基金管理有限公司投资经理;自2015年5月起任富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金基金经理,自2016年11月起任富国中证医药主题指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理,2017年3月起任富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理,2017年7月起任富国中证高端制造指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理,2017年11月至2018年12月任富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金,2018年11月起任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2018年12月起任富国中证价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2019年7月起任富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金经理;兼任量化投资部量化投资副总监。具有基金从业资格。
(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:田国立
成立时间:2004年9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
2、主要人员情况
纪伟,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职,并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历,熟悉各项托管业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
龚毅,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部开拓任副行长,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,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),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。
郑绍平,资产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、战略客户部,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。
原订,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行国际业务部,长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作,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、(R)QFII、(R)QDII、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2018年二季度末,中国建设银行已托管857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。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项,并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。
(三)基金验资机构
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
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
执行事务合伙人:毛数守
联系电话:021-22288888
传真:021-22280000
联系人:蒋燕华
经办注册会计师:蒋燕华、石静筠

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

(一)基金募集期间费用
本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。
(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2019年8月19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(2019年08月19日)
资 产:	
银行存款	2,127,713,510.27
结算备付金	13,744,699.62
存出保证金	20,699.44
交易性金融资产	5,422,060,463.22
其中:股票投资	5,422,060,463.22
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
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	1,372,315.06
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	659,148.09
资产总计	7,565,570,835.70
负债和所有者权益	本期末(2019年08月19日)
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	337,139,012.97
应付赎回款	-
应付管理人报酬	1,847,673.33
应付托管费	369,534.66
应付销售服务费	-
应付交易费用	3,397,980.93
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	183,196.55
负债合计	342,937,398.44
所有者权益:	
实收基金	7,202,329,199.00
未分配利润	20,304,238.26
所有者权益合计	7,222,633,437.26
负债和所有者权益总计	7,565,570,835.70

八、基金投资组合

截至2019年8月19日,本基金的投资组合如下:
(一)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	5,422,060,463.22	71.67
	其中:股票	5,422,060,463.22	71.67
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	-	-
	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	2,141,458,209.89	28.31
7	其他资产	2,052,162.59	0.03
8	合计	7,565,570,835.70	100.00

(二)按行业分类的股票投资组合
1、积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	25,368.80	0.00
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	-	-
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	-	-
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	25,368.80	0.00

2、指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	5,272,985,214.42	73.01
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	-	-
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	-	-
J	金融业	149,049,880.00	2.06
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	5,422,035,094.42	75.07

(三)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、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	600760	中航沈飞	24,037,818	714,644,329.14	9.89
2	600372	中航电子	40,362,100	561,033,190.00	7.77
3	600038	中直股份	11,939,742	542,661,273.90	7.51
4	000768	中航飞机	27,621,200	424,814,056.00	5.88
5	002179	中航光电	8,643,197	339,504,778.16	4.70
6	002013	中航机电	39,674,300	255,899,235.00	3.54
7	000519	中兵红箭	27,873,200	213,229,980.00	2.95
8	600893	航发动力	7,935,200	180,287,744.00	2.50
9	002415	海康威视	5,747,445	179,780,079.60	2.49
10	300114	中航电测	15,558,800	149,986,832.00	2.08

2、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

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	603992	松霖科技	1,135	15,367.90	0.00
2	603755	日辰股份	637	10,000.90	0.00

(四)按债券品种分类的债券投资组合
注:截至2019年8月19日,本基金未持有债券。
(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投资明细
注:截至2019年8月19日,本基金未持有债券。
(六)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:截至2019年8月19日,本基金未持有资产支持证券。
(七)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
注:截至2019年8月19日,本基金未持有贵金属投资。
(八)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
注:截至2019年8月19日,本基金未持有权证。
(九)本基金投资的股指期货交易情况说明
注:截止2019年8月19日,本基金未持有股指期货。
(十)本基金投资的国债期货交易情况说明
注:截止2019年8月19日,本基金未持有国债期货。
(十一)投资组合报告附注
1、申明本基金股票库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、处罚的情形。
本报告编制日前一年内,本基金投资的“中兵红箭”股票的发行主体中兵红箭股份有限公司(以下简称“公司”)于2018年11月2日公告,公司于2018年10月31日收到湖南监管局《行政处罚决定书》([2018]13号),因公司存在信息披露违法违规行为,湖南监管局对公司出具责令改正,给予警告,并处以30万元罚款的行政处罚。
中兵红箭为本基金跟踪标的指数的成分股。
本基金投资的其余九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。
本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。
3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	20,699.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,372,315.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	659,148.09
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,052,162.59

4、基金持有的处于转股期的可转换债券明细
注:截止2019年8月19日,本基金未持有可转换债券。
5、前十名股票中在在流通受限情况的说明
(1)指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:截止2019年8月19日,本基金指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。
(2)积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603992	松霖科技	15,367.90	0.00	认购新股
2	603755	日辰股份	10,000.90	0.00	认购新股

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、上海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、基金份额净值计算进行监督和核查,如发现基金管理人违反《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,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)中国证监会准予本基金募集注册的文件
(二)《富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
(三)《富国中证军工龙头交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
(四)《富国中证军工龙头交易型开放式指数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、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务
(一)基金管理人的权利与义务
1、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,应星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)担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金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、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及转融通;
(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、期货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、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回等的业务规则;
(17)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、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,不得委托第三人运作基金财产;
(5)依法接受基金托管人的监督;
(6)采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、赎回对价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、基金份额净值,确定基金份额申购、赎回的对价,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、足额支付投资者申购或赎回之基金份额的投资者应收对价;
(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;
(17)确保需要向基金托管人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;
(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(税后)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)建立并保存基金份额持有人名册;
(27)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)基金托管人的权利与义务
1、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独立运用并管理基金财产;
(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,如发现基金管理人有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者的利益;
(4)根据相关市场规则,为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户,为基金办理证券、期货等交易资金清算;
(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,提名新的基金托管人;
(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。
2、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,不得委托第三人运作基金财产;
(5)保管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