

# B090 信息披露 | Disclosure

(上接B089版)

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、基本养老金个人账户、(R)OPII、(R)ODII、企业年金、信托业务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2019年二季度末,中国建设银行已托管924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”。

## 第三部分相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1. 申购赎回代理券商

序号	机构名称	机构信息
1	国泰君安证券股份有限公司	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号 办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼 法定代表人:杨德红 客服电话:96521 网址:www.gtja.com
2	中信建投证券股份有限公司	注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼 办公地址:北京东城区朝内大街2号凯恒中心B座18层 法定代表人:王常青 客服电话:96587、4008-888-108 网址:www.csc108.com
3	国信证券股份有限公司	注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼 办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼 法定代表人:何如 客服电话:96536 网址:www.guosen.com.cn
4	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区福华一路111号招商证券大厦23楼 办公地址:深圳市福田区福华一路111号招商证券大厦23楼 法定代表人:霍达 客服电话:400-888-8111、96565 网址:www.newone.com.cn
5	中国银河证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街5号2-6层 办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座 法定代表人:陈共炎 客服电话:4008-888-888、96551 网址:www.chinastock.com.cn
6	海通证券股份有限公司	注册地址:上海市广东路689号 办公地址:上海市广东路689号 法定代表人:王开国 客服电话:96553 网址:www.htsec.com
7	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 办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层 法定代表人:李梅 客服电话:96523、400895523 网址:www.swhysc.com
8	兴业证券股份有限公司	注册地址:福建省福州市湖东路268号 办公地址:上海市浦东新区龙柳路36号 法定代表人:杨华辉 客服电话:96562 网址:www.xyzq.com.cn
9	万联证券股份有限公司	注册地址:广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层 办公地址:广东省广州市天河区珠江东路13号高德置地广场E座12层 法定代表人:罗秋斌 客服电话:96322 网址:www.wljzq.com
10	东吴证券股份有限公司	注册地址:苏州工业园区星阳街5号 办公地址:苏州工业园区星阳街5号 法定代表人:范力 客服电话:96330 网址:www.dwzq.com.cn
11	国盛证券有限责任公司	注册地址:江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行南昌分行营业大楼 办公地址:江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行南昌分行营业大楼 法定代表人:徐丽娜 客服电话:4008-222-111 网址:www.gszq.com
12	光大证券股份有限公司	注册地址:上海市静安区新闸路1508号 办公地址:上海市静安区新闸路1508号 法定代表人:周健男 客服电话:96525 网址:www.ebsc.com.cn
13	广发证券股份有限公司	注册地址:广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室 办公地址:广州市天河区马场路26号广发证券大厦 法定代表人:孙树明 客服电话:96575 网址:www.gf.com.cn
14	中信证券股份有限公司	注册地址: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 办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 法定代表人:张佑君 客服电话:96548 网址:www.csc.ecitic.com
15	中信证券(山东)有限责任公司	注册地址:青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001 办公地址:青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层 法定代表人:姜晓琳 客服电话:96548 网址:sd.citics.com
16	华泰证券股份有限公司	注册地址:南京市江东中路228号 办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场、上海市东方路1818号保利广场A座 法定代表人:周易 客服电话:96597 网址:www.htzq.com.cn
17	长江证券股份有限公司	注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦 办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦 法定代表人:李新华 客服电话:96579 网址:www.96579.com
18	中泰证券股份有限公司	注册地址:山东省济南市市中区经七路86号 办公地址:山东省济南市市中区经七路86号 法定代表人:李玮 客服电话:96538 网址:www.ztsc.com.cn
19	安信证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦36层、28层A02单元 办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦36层、28层A02单元 法定代表人:王连志 客服电话:400-800-1001 网址:www.essence.com.cn
20	中国中投证券有限责任公司	注册地址:深圳市福田区益田路5033号平安金融中心A栋第18层-21层及第04层01020306.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元 办公地址:深圳市福田区益田路与福中路交界荣超商务中心A栋第18层-21层 法定代表人:高涛 客服电话:96532 网址:www.china-invs.cn
21	平安证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层 办公地址:深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层 法定代表人:何之江 客服电话:96511-8 网址:stock.pingan.com
22	德邦证券股份有限公司	注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼 办公地址:上海市浦东新区世纪大道1600号城建国际中心19楼 法定代表人:冯鹤春 客服电话:4008888128 网址:www.tebon.com.cn
23	中航证券有限公司	注册地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融中心A栋41层 办公地址:北京市朝阳区望京园四区2号中航资本大厦36层 法定代表人:王晟峰 客服电话:96335 网址:www.avicsec.com
24	方正证券股份有限公司	注册地址:湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远中心4、5号楼3701-3717 办公地址:北京市朝阳区北四环7号盘古大观A座40楼 法定代表人:施华 客服电话:96571 网址:www.foundsec.com
25	湘财证券股份有限公司	注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号南城商务中心A栋11楼 办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号南城商务中心A栋11楼 法定代表人:孙永祥 客服电话:96531 网址:www.xcsc.com

26	华鑫证券有限责任公司	注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元 办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号 法定代表人:俞洋 客服电话:96323 网址:www.cfsc.com.cn
27	申万宏源西部证券有限公司	注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 法定代表人:李琦 客服电话:400800062 网址:www.hysec.com
28	华西证券股份有限公司	注册地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 办公地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦 法定代表人:杨舸祥 客服电话:96584 网址:www.hx168.com.cn
29	长城证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17层 办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16-17层 法定代表人:曹宏 客服电话:96514、400-6666-888 网址:www.cgws.com

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。

3. 基金管理人可根据有关法律、法规要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述发售代理机构,并在管理人网站公示。

### 二、注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司  
地址:北京市西城区太平桥大街17号  
法定代表人:周明  
联系电话:021-58872935  
传真:021-68870311

联系人:郑奕莉  
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:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼  
办公地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19楼  
负责人:俞卫锋  
联系电话:021-31358666  
传真:021-31358600

经办律师:黎明、丁媛  
联系人:丁媛  
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:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元

办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼  
执行事务合伙人:李丹  
联系电话:021-23238888  
传真:021-23238800

联系人:魏佳亮  
经办注册会计师:许康玮、魏佳亮

第四部分 基金名称  
国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金

第五部分 基金类型和存续期限  
1. 基金类型:股票型证券投资基金  
2. 基金运作方式:交易型开放式  
3. 基金的存续期间:不定期

第六部分 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。

第七部分 投资范围  
本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为了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投资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。

第八部分 投资策略  
1. 股票投资策略  
本基金主要采用完全复制法,即按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况(如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等)导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时,基金管理人将对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差超过2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

2. 债券投资策略  
基于流动性管理的需要,本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债等固定收益类品种,其目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。

3. 资产支持证券投资策略  
本基金投资资产支持证券将综合考虑信用等级、债券期限结构、分散化投资、行业分布等因素,坚持价值投资理念,把握市场交易机会。在严格遵守法律法规的基础上,通过信用研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

4. 权证投资策略  
本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,结合权证定价模型寻求其合理估值水平,并积极参与正股和权证之间的不同组合来套取无风险收益。本基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

第九部分 业绩比较基准  
本基金的业绩比较基准为标的指数收益率,即中证军工指数收益率。如果中证指数有限公司变更或停止中证军工指数的编制及发布,或者中证军工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中证军工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更具代表性、更适用于投资的指数推出,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,在履行适当程序后有权变更本基金的标的指数并相应地变更业绩比较基准,而无需召开基金份额持有人大会审议。

第十部分 风险收益特征  
本基金属于股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于较高风险、较高收益的基金。

本基金为指数型股票基金,主要通过完全复制策略,跟踪中证军工指数,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

第十一部分 投资组合报告  
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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16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2019年6月30日。本报告所列财务数据

未经审计。  
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	1,916,604,837.98	98.62
	其中:股票	1,916,604,837.98	98.62
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	25,911,648.18	1.33
7	其他各项资产	945,512.25	0.05
8	合计	1,943,461,998.41	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### (1) 积极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	363,431.25	0.02
C	制造业	176,907.28	0.01
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	39,603.76	0.00
J	金融业	33,869.94	0.00
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	23,106.60	0.00
S	综合	--	--
	合计	636,918.83	0.03

(2) 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	1,807,505,006.75	94.09
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	108,463,462.40	5.65
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	1,915,968,469.15	99.74

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

(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

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	36,010,752	200,219,781.12	10.42
2	000768	中航飞机	8,227,824	129,588,228.00	6.75
3	600893	航发动力	5,401,630	122,671,017.30	6.39
4	002179	中航光电	3,085,417	103,238,052.82	5.37
5	600482	中国动力	4,115,499	97,208,086.38	5.06
6	002465	海格通信	9,513,477	90,758,570.58	4.72
7	002268	卫士通	3,342,432	81,722,462.40	4.25
8	600118	中国卫星	3,601,089	81,204,556.95	4.23
9	600879	航天电子	12,851,510	79,165,301.60	4.12
10	600760	中航沈飞	2,572,212	74,671,314.36	3.89

(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

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	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.02
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
4	603863	松药资源	1,612	37,204.96	0.00
5	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合  
本基金本报告期末未持有债券。

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  
本基金本报告期末未持有债券。

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  
(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。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策  
本基金本报告期末未持有股指期货。若本基金投资股指期货,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过中证期货市场与期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。

11. 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(除“中航光电”公告违规外)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。

2019年3月21日,中航光电披露《2018年度募集资金存放与使用情况的专项报告》,称公司分别于2018年12月和2019年1月将自有流动资金34513万元和30000万元汇入募集资金补充流动资金专户。公司上述募集资金专户存放非募集资金的行为违反了深交所相关规定,受到深交所监管关注。

该情况发生后,本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究,认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响,对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公

司进行跟踪研究。

(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) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	838,214.11
2	应收证券清算款	102,667.63
3	应收股利	--
4	应收利息	4,630.61
5	应收申购款	--
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	945,512.25

(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  
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

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	601236	红塔证券	33,869.94	0.00	网下新股

第十二部分 基金的业绩  
基金业绩截止日为2019年6月30日,并经基金托管人复核。

基金管理人依照恪守职守、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。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。

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
2016年7月26日至2016年12月31日	-2.15%	1.02%	-8.66%	1.11%	6.51%	-0.09%
2017年度	-13.90%	1.29%	-18.37%	1.28%	4.47%	0.01%
2018年度	-26.98%	1.80%	-27.25%	1.82%	0.27%	-0.02%
2019年上半年	19.86%	1.96%	19.76%	1.97%	0.10%	-0.01%
2016年7月26日至2019年6月30日	-26.26%	1.57%	-35.04%	1.59%	8.78%	-0.02%

注:本基金基金合同生效日为2016年7月26日。

第十三部分 基金费用与税收  
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事务所、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。

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0.50%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为前一日基金资产净值