

(上接 D91 版)

Table with 4 columns: 序号, 名称, 注册地址, 办公地址. Lists various companies and their contact information.

2. 二级市场交易代理商
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 基金的名称
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、权证以及法律法规和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,基金管理人可在履行适当程序后,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。
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%,年跟踪误差不超过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,并积极利用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,即中证全指证券公司指数收益率。

如果中证指数有限公司变更或停止中证全指证券公司指数的编制及发布,或者中证全指证券公司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全指证券公司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。
本基金为指数型基金,主要采用完全复制策略,跟踪中证全指证券公司指数,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
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

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Shows industry allocation data.

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Shows industry allocation data.

(2) 指数投资按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%). Shows industry allocation data.

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

Table with 5 columns: 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(%). Lists top 10 stocks.

(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

Table with 5 columns: 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(%). Lists top 5 active investments.

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

Table with 5 columns: 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(%). Lists top 5 bond investments.

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投资股指期货。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,将通过对其证券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“中信证券”分公司、“广发证券”、“东方证券”控股参股公司、“兴业证券”控股参股公司违规外)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。

2018年12月18日,中信证券江苏分公司由于违反反洗钱规定,收到中国人民银行南京分行罚款20万元。

广发证券存在以低于成本价格参与公司债券项目投标的情形,违反了公司债券发行与交易的相关规定,在2019年4月被广东证监局责令整改。

2019年3月25日广发证券收到广东证监局《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》(广东证监局行政监管措施决定书[2019]20号),指出公司存在对境外子公司管控不到位,未有效督促境外子公司强化合规风险管理及审慎开展业务等问题,违反了相关规定,广东证监局决定对公司采取责令改正的行政监管措施。

2018年11月17日,中国证监会指出东方证券控股参股公司东方花旗为粤传媒重大资产重组出具的财务顾问报告存在虚假记载,东方花旗作为粤传媒重大资产重组项目的独立财务顾问,在尽职调查过程中未勤勉尽责;未遵守尽职调查制度,未制定尽职调查清单和各主要阶段工作内容;未全面评估粤传媒并购重组活动所涉及的风险;未对上市公司并购重组活动进行充分、广泛、合理的调查,对香榭丽收入及应收账款核查程序缺失;内核机构未对应收账款问题进行核实,仅凭项目组的回复即通过审核,内核程序流于形式。东方花旗的上述行为违反了相关规定。中国证监会决定责令东方花旗改正,没收业务收入595万元,并处以1785万元罚款。

2018年8月18日,兴业证券莆田园中街证券营业部由于营业部原负责人及员工在营业部任职期间存在违规为客户之间的融资融券提供便利等问题,反映营业部内部控制不完善,收到证监会福建监管局警示函。

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

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元). Shows asset composition data.

(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 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

Table with 5 columns: 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. Lists restricted investments.

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信守、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。

Table with 7 columns: 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. Shows performance metrics.

注:本基金基金合同生效日为2016年7月26日。

第十三部分 基金的费用与税收

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 × 0.50% ÷ 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 × 0.10% ÷ 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 × 0.03% ÷ 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“一、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。

三、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。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律法规执行。

第十四部分 对基金招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对2019年12月31日刊登的本基金招募说明书进行了更新,更新的主要内容如下:

根据本基金管理人于2020年1月17日发布的《国泰基金管理有限公司关于修订旗下8只ETF基金托管协议及招募说明书的公告》对《招募说明书》“重要提示”及“第十部分 基金份额的申购与赎回”相关内容进行了更新。

上述内容仅为本更新招募说明书的摘要,详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书正文,可登陆国泰基金管理有限公司网站 www.gtfund.com。