

# 景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

## 2019 年第 1 号更新招募说明书摘要

### 【重要提示】

(一) 景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）由基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关规定募集，并经中国证监会 2018 年 3 月 27 日证监许可【2018】548 号文准予募集注册。本基金基金合同于 2018 年 4 月 27 日正式生效。

(二) 基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、收益和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

(三) 投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

(四) 基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

(五) 基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

(六) 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益，也不保证本金安全。

(七) 本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人根据所持有的基

基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金为交易型开放式指数证券投资基金（ETF），将在上海证券交易所上市。本基金的标的指数组合证券横跨上海及深圳两个证券交易所。通常情况下，投资人申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；即在目前结算规则下，T日申购的基金份额当日可卖出，T日申购当日未卖出的基金份额，T+1日不得卖出和赎回，T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。因此为投资人办理申购业务的代理机构若发生交收违约，将导致投资人不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资人的利益可能受到影响。投资人投资本基金时需具有上海证券账户，但需注意，使用上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资人需要使用标的指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所A股账户；如投资人需要使用标的指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所A股账户。

（八）投资人在投资本基金前，请认真阅读本招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购和/或申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括但不限于：市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作或技术风险、合规风险、本基金的特定风险和其他风险等。

（九）投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。投资者申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；即在目前结算规则下，T日申购的基金份额当日可卖出，T日申购当日未卖出的基金份额，T+1日不得卖出和赎回，T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。投资者赎回获得的股票当日可卖出。因此为投资者办理申购业务的代理券商若发生交收违约，将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资者的利益可能受影响。由于股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回申请，使得基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，基金面临流动性风险。

（十）本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2019年4月27日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年3月31日。本招募说明书中财务数据未经审计。

**基金管理人：景顺长城基金管理有限公司**

**基金托管人：中国农业银行股份有限公司**

## 一、基金管理人概况

### (一) 基金管理人概况

名称：景顺长城基金管理有限公司

住所：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层

设立日期：2003 年 6 月 12 日

法定代表人：丁益

注册资本：1.3 亿元人民币

批准设立文号：证监基金字 [2003] 76 号

办公地址：深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第 1 座 21 层

电话：0755-82370388

客户服务电话：400 8888 606

传真：0755-22381339

联系人：杨皞阳

股东名称及出资比例：

| 序号 | 股东名称         | 出资比例 |
|----|--------------|------|
| 1  | 长城证券股份有限公司   | 49%  |
| 2  | 景顺资产管理有限公司   | 49%  |
| 3  | 开滦（集团）有限责任公司 | 1%   |
| 4  | 大连实德集团有限公司   | 1%   |
| 合计 |              | 100% |

### (二) 主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

丁益女士，董事长，经济学博士。曾担任中国人民大学财政金融学院讲师；华能国际电力股份有限公司证券融资部干部，证券融资部投资关系处副处长、处长，证券融资部副经理兼投资关系处处长；中国人民保险公司投资管理部副总经理；中国人保资产管理有限公司党委委员、董事、总裁助理；华能资本常务副总经理（主持工作）、党组副书记；华能资本总经理、党组副书记。现任华能资本服务有限公司董事长、党组书记，景顺长城基金管理有限

公司董事长。

康乐先生，董事，总经理，经济学硕士。曾先后担任中国人寿资产管理有限公司研究部研究员、组合管理部投资经理、国际业务部投资经理，景顺投资管理有限公司市场销售部经理、北京代表处首席代表，中国国际金融有限公司销售交易部副总经理。2011年7月加入本公司，现任公司董事兼总经理。

罗德城先生，董事，工商管理硕士。曾任大通银行信用分析师、花旗银行投资管理部副总裁、Capital House亚洲分公司的董事总经理。1992至1996年间出任香港投资基金公会管理委员会成员，并于1996至1997年间担任公会主席。1997至2000年间，担任香港联交所委员会成员，并在1997至2001年间担任香港证监会顾问委员会成员。现任景顺集团亚太区首席执行官。

李翔先生，董事，高级管理人工工商管理硕士。曾任长城证券股份有限公司人事部副总经理、人事监察部总经理、营业部总经理、公司营销总监、营销管理部总经理。现任长城证券股份有限公司副总裁、党委委员。

伍同明先生，独立董事，文学学士。香港会计师公会会员（HKICPA）、英国特许公认会计师（ACCA）、香港执业会计师（CPA）、加拿大公认管理会计师（CMA）。拥有超过二十年以上的会计、审核、管治税务的专业经验及知识，1972-1977受训于国际知名会计师楼“毕马威会计师行”[KPMG]。现为“伍同明会计师行”所有者。

靳庆军先生，独立董事，法学硕士。曾担任中信律师事务所涉外专职律师，在香港马士打律师行、英国律师行Clyde&Co. 从事律师工作，1993年发起设立信达律师事务所，担任执行合伙人。现任金杜律师事务所合伙人。

闵路浩先生，独立董事，经济学硕士。曾担任中国人民银行金融管理公司科员、主任科员；中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长；中国银行业监督管理委员会非银行金融机构监管部处长、副巡视员、巡视员；中国小额贷款公司协会会长；重庆富民银行行长。现担任北京中泰创汇股权投资基金管理有限公司总裁。

## 2、基金管理人监事会成员

阮惠仙女士，监事，会计学硕士。现任长城证券股份有限公司财务部总经理。

郭慧娜女士，监事，管理学硕士。曾任伦敦安永会计师事务所核数师，历任景顺投资管理有限公司项目主管、业务发展部副经理、企业发展部经理、亚太区监察总监。现任景顺投资管理有限公司亚太区首席行政官。

邵媛媛女士，监事，管理学硕士。曾任职于深圳市天健（信德）会计师事务所、福建兴业银行深圳分行计财部。现任景顺长城基金管理有限公司基金事务部总监。

杨波先生，监事，工商管理硕士。曾任职于长城证券经纪业务管理部。现任景顺长城基金管理有限公司交易管理部总监。

### 3、高级管理人员

丁益女士，董事长，简历同上。

康乐先生，总经理，简历同上。

CHEN WENYU（陈文宇），副总经理，工商管理硕士。曾担任中国海口电视台每日新闻记者及每周金融新闻节目制作人，安盛罗森堡投资管理公司（美国加州）美洲区副首席投资官、以及研究、投资组合管理和策略等其他多个职位，安盛投资管理亚洲有限公司（新加坡）泛亚地区首席投资官，主要负责投资组合管理、研究、交易等相关业务。2018年9月加入本公司，现任公司副总经理。

毛从容女士，副总经理，经济学硕士。曾任职于交通银行深圳市分行国际业务部，担任长城证券金融研究所高级分析师、债券小组组长。2003年3月加入本公司，现任公司副总经理。

黎海威先生，副总经理，经济学硕士。曾担任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012年8月加入本公司，现任公司副总经理。

赵代中先生，副总经理，理学硕士。曾担任深圳发展银行北京分行金融同业部投资经理、宁夏嘉川集团项目部项目负责人、全国社会保障基金理事会境外投资部全球股票处处长、浙江大钧资产管理有限公司合伙人兼副总经理。2016年3月加入本公司，现任公司副总经理。

吴建军先生，副总经理兼首席信息官，经济学硕士。曾担任海南汇通国际信托投资公司证券部副经理，长城证券股份有限公司机构管理部总经理、公司总裁助理。2003年3月加入本公司，现任公司副总经理兼首席信息官。

刘焕喜先生，副总经理，投资与金融系博士。曾担任武汉大学教师工作处副科长、武汉大学成人教育学院讲师，《证券时报》社编辑记者，长城证券研发中心研究员、总裁办副主任、行政部副总经理。2003年3月加入本公司，现任公司副总经理。

杨峰阳先生，督察长，法学硕士。曾担任黑龙江省大庆市红岗区人民法院助理审判员，南方基金管理有限公司监察稽核部监察稽核经理、监察稽核高级经理、总监助理。2008 年 10 月加入本公司，现任公司督察长。

#### 4、本基金基金经理简历

徐喻军先生，理学硕士。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员；自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理，现担任量化及指数投资部总监助理兼基金经理。具有 9 年证券、基金行业从业经验。

#### 5、本基金基金经理曾管理的基金名称及管理时间

本基金现任基金经理徐喻军先生曾于 2014 年 4 月至 2018 年 5 月管理景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金；2014 年 4 月至 2018 年 7 月管理景顺长城上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金；2014 年 4 月至 2019 年 1 月管理上证 180 等权重交易型开放式指数证券投资基金。

#### 6、本基金基金经理兼任其他基金基金经理的情况

本基金基金经理徐喻军先生兼任景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金和景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。

#### 7、本基金历任基金经理姓名及管理时间

无。

#### 8、投资决策委员会委员名单

本公司的投资决策委员会由公司总经理、分管投资的副总经理、各投资总监、研究总监、基金经理代表等组成。

公司的投资决策委员会成员姓名及职务如下：

康乐先生，总经理；

CHEN WENYU（陈文字），副总经理；

毛从容女士，副总经理；

黎海威先生，副总经理兼量化及指数投资部投资总监；

余广先生，总经理助理兼股票投资部投资总监；

刘彦春先生，总经理助理兼研究部总监。

9、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人情况

### （一）基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化

竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## （二）主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 240 名，其中具有高级职称的专家 30 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## （三）基金托管业务经营情况

截止到 2019 年 3 月 31 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 440 只。

## （四）基金托管人的内部风险控制制度说明



### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

#### (五) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金份额发售机构

##### 1、申购赎回代理券商（简称：一级交易商）

| 序号 | 全称           | 销售机构信息   |
|----|--------------|--|
| 1  | 长城证券股份有限公司   | 注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 层<br>法定代表人：曹宏<br>办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层<br>客户服务电话：4006666888<br>联系人：金夏<br>联系电话：0755-83516289<br>邮箱：jinxia@cgws.com<br>网址：www.cgws.com        |
| 2  | 广发证券股份有限公司   | 注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）<br>办公地址：广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦<br>法定代表人：孙树明<br>联系人：黄岚<br>电话：020-87555888<br>传真：020-87555305<br>客户服务电话：95575<br>网址：www.gf.com.cn                          |
| 3  | 中国银河证券股份有限公司 | 办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座<br>注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层<br>法定代表人：陈共炎<br>联系人：辛国政<br>联系电话：010-83574507<br>传真：010-83574807<br>客服电话：4008-888-888 或 95551<br>公司网址：www.chinastock.com.cn<br>邮政编码：100033 |
| 4  | 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<br>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<br>法定代表人：杨德红<br>联系人：芮敏祺<br>电话：021-38676666<br>传真：021-38670161   |

|    |              |  |
|----|--------------|--|
|    |              | <p>客户服务电话: 95521<br/>网址: <a href="http://www.gtja.com">www.gtja.com</a></p>  |
| 5  | 中信建投证券股份有限公司 | <p>注册(办公)地址: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼<br/>法定代表人: 王常青<br/>联系人: 许梦园<br/>电话: (010) 85156398<br/>传真: (010) 65182261<br/>客户服务电话: 4008888108/95587<br/>网址: <a href="http://www.csc108.com">www.csc108.com</a></p>             |
| 6  | 申万宏源证券有限公司   | <p>注册(办公)地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层<br/>法定代表人: 李梅<br/>联系人: 曹晔<br/>电话: 021-33389888<br/>传真: 021-33388224<br/>客户服务电话: 95523 或 4008895523<br/>网址: <a href="http://www.swhysc.com">www.swhysc.com</a></p>                |
| 7  | 申万宏源西部证券有限公司 | <p>注册(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<br/>法定代表人: 李季<br/>联系人: 王君<br/>电话: 0991-7885083<br/>传真: 0991-2310927<br/>客户服务电话: 400-800-0562<br/>网址: <a href="http://www.hysec.com">www.hysec.com</a></p> |
| 8  | 招商证券股份有限公司   | <p>注册(办公)地址: 深圳市益田路江苏大厦 38-45 层<br/>法定代表人: 宫少林<br/>联系人: 黄婵君<br/>电话: 0755-82943666<br/>传真: 0755-83734343<br/>客户服务电话: 400-8888-111, 95565<br/>网址: <a href="http://www.newone.com.cn">www.newone.com.cn</a></p>       |
| 9  | 兴业证券股份有限公司   | <p>注册地址: 福州市湖东路 268 号<br/>办公地址: 上海市浦东新区长柳路 36 号<br/>法定代表人: 杨华辉<br/>联系人: 乔琳雪<br/>联系电话: 021-38565547<br/>传真: 0591-38507538<br/>客户服务电话: 95562<br/>网址: <a href="http://www.xyzq.com.cn">www.xyzq.com.cn</a></p>        |
| 10 | 光大证券股份有限公司   | <p>注册(办公)地址: 上海市静安区新闻路 1508 号<br/>法定代表人: 周健男<br/>联系人: 郁疆<br/>电话: 021-22169999<br/>传真: 021-22169134</p>   |

|    |              |   |
|----|--------------|---|
|    |              | <p>客户服务电话：95525、4008888788、10108998<br/>网址：www.ebscn.com</p>  |
| 11 | 海通证券股份有限公司   | <p>注册（办公）地址：上海市广东路 689 号<br/>法定代表人：周杰<br/>联系人：李笑鸣<br/>电话：021-23219000<br/>传真：021-23219100<br/>客服电话：95553<br/>网址：www.htsec.com</p>   |
| 12 | 安信证券股份有限公司   | <p>注册（办公）地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元<br/>法定代表人：牛冠兴<br/>联系人：郑向溢<br/>电话：0755-82558038<br/>传真：0755-82558355<br/>客户服务电话：4008001001<br/>网址：www.essence.com.cn</p> |
| 13 | 平安证券股份有限公司   | <p>注册（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<br/>法人代表：何之江<br/>联系人：王阳<br/>电话：021-38632136<br/>传真：021-33830395<br/>客户服务电话：95511-8<br/>网址：stock.pingan.com</p>               |
| 14 | 国信证券股份有限公司   | <p>注册（办公）地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层<br/>法定代表人：何如<br/>联系人：李颖<br/>电话：0755-82130833<br/>传真：0755-82133952<br/>客户服务电话：95536<br/>网址：www.guosen.com.cn</p>               |
| 15 | 中国国际金融股份有限公司 | <p>注册（办公）地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 28 层<br/>法定代表人：丁学东<br/>联系人：杨涵宇<br/>电话：010-65051166<br/>客户服务电话：400 910 1166<br/>网址：www.cicc.com.cn</p>                                   |
| 16 | 方正证券股份有限公司   | <p>注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层<br/>办公地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼 2701-3717</p>  |

|    |                |   |
|----|----------------|---|
|    |                | <p>法定代表人：高利<br/>                 联系人：胡创<br/>                 电话：010-59355941<br/>                 传真：010- 56437013<br/>                 客服热线：95571<br/>                 网址：www.foundersc.com</p>  |
| 17 | 华泰证券股份有限公司     | <p>注册（办公）地址：江苏省南京市江东中路 228 号<br/>                 法定代表人：周易<br/>                 联系人：庞晓芸<br/>                 电话：0755-82492193<br/>                 客户服务电话：95597<br/>                 网址：www.htsc.com.cn</p>   |
| 18 | 中信证券股份有限公司     | <p>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<br/>                 办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦<br/>                 法定代表人：张佑君<br/>                 联系人：王一通<br/>                 电话：010—60838888<br/>                 传真：010—60833739<br/>                 客服电话：95548<br/>                 网址：www.cs.ecitic.com</p> |
| 19 | 长江证券股份有限公司     | <p>注册（办公）地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦<br/>                 法定代表人：杨泽柱<br/>                 联系人：奚博宇<br/>                 电话：027-65799999<br/>                 传真：027-85481900<br/>                 客户服务电话：95579 或 4008-888-999<br/>                 网址：www.95579.com</p>  |
| 20 | 中泰证券股份有限公司     | <p>注册（办公）地址：济南市市中区经七路 86 号<br/>                 法定代表人：李玮<br/>                 联系人：许曼华<br/>                 电话：021-20315290<br/>                 传真：021-20315125<br/>                 客户服务电话：95538<br/>                 网址：www.zts.com.cn</p>  |
| 21 | 中信证券（山东）有限责任公司 | <p>注册（办公）地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001<br/>                 法定代表人：姜晓林<br/>                 联系人：刘晓明<br/>                 联系电话：0531—89606165<br/>                 传真：0532-85022605<br/>                 客户服务电话：95548<br/>                 网址：www.zxwt.com.cn</p>   |
| 22 | 华鑫证券有限责任公司     | <p>注册（办公）地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大</p>   |

|  |  |
|--|--|
|  | 厦 28 层 A01、B01 (b) 单元<br>法定代表人：俞洋<br>联系人：朱泽乾<br>电话：021-54967367<br>传真：021-54967032<br>客户服务电话：95323，4001099918（全国） 021-32109999； 029-68918888<br>网址：www.cfsc.com.cn |
|--|--|

## 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。

### （二）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司  
注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号  
办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号  
法定代表人：周明  
联系人：王博  
联系电话：021-68870172

### （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：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼  
办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼  
负责人：俞卫锋  
电话：021-31358666  
传真：021-31358600  
经办律师：黎明、陈颖华  
联系人：陈颖华

### （四）审计基金财产的会计师事务所

法定名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）  
注册地址：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

执行事务合伙人：李丹

电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：许康玮、朱宏宇

#### 四、基金的名称

景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金

#### 五、基金的类型

交易型开放式

#### 六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，以期获得与标的指数收益相似的回报。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。

#### 七、基金的投资方向

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金资产以及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的相关规定）。

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，可以将其纳入投资范围。

基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。

#### 八、基金的投资策略

本基金以 MSCI 中国 A 股国际通指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全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为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情



况（包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

## 九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股国际通指数（MSCI China A Inclusion RMB Index (CNY)）。

若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，如果指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权，或标的指数由其他指数替代（其编制方法发生实质性变更的）、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为原标的指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，在按监管部门要求履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名、标的指数由其他指数替代（其编制方法未发生实质性变更的）等事项），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的

指数和对基金合同进行相应修改（包括但不限于基金名称变更），报中国证监会备案并及时公告。

## 十、风险收益特征

本基金为股票型指数基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。

## 十一、基金投资组合报告

景顺长城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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据基金合同规定，已经复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。财务数据截至 2019 年 3 月 31 日，本报告中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              | 787,102,092.29 | 96.42        |
|    | 其中：股票             | 787,102,092.29 | 96.42        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 924,000.00     | 0.11         |
|    | 其中：债券             | 924,000.00     | 0.11         |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -              | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 28,145,458.34  | 3.45         |
| 8  | 其他资产              | 193,499.83     | 0.02         |
| 9  | 合计                | 816,365,050.46 | 100.00       |

注:本表权益投资股票项中, 含可退替代款估值增值 10,031.00 元, 而 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合中不含可退替代款估值增值, 因此二者存在差异。

## 2.报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末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         | 4,229,108.00   | 0.53         |
| B  | 采矿业              | 29,915,811.90  | 3.73         |
| C  | 制造业              | 299,085,992.01 | 37.30        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 25,318,820.18  | 3.16         |
| E  | 建筑业              | 26,240,606.20  | 3.27         |
| F  | 批发和零售业           | 15,127,973.74  | 1.89         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 22,574,461.32  | 2.82         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 29,903,205.89  | 3.73         |
| J  | 金融业              | 272,188,964.45 | 33.95        |
| K  | 房地产业             | 46,674,685.70  | 5.82         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 9,491,765.20   | 1.18         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 791,539.00     | 0.10         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 2,327,096.20   | 0.29         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 2,929,033.00   | 0.37         |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 786,799,062.79 | 98.14        |

### 2.2 报告期末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              | 125,752.56 | 0.02         |
| 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 | 32,902.94  | 0.00 |
| J | 金融业             | 134,343.00 | 0.02 |
| 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              | 292,998.50 | 0.04 |

### 2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 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

### 3.1 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  | 600519 | 贵州茅台 | 51,777    | 44,217,040.23 | 5.52         |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 435,800   | 33,600,180.00 | 4.19         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 818,769   | 27,772,644.48 | 3.46         |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 822,100   | 14,937,557.00 | 1.86         |
| 5  | 000858 | 五粮液  | 154,600   | 14,687,000.00 | 1.83         |
| 6  | 600000 | 浦发银行 | 1,174,500 | 13,248,360.00 | 1.65         |
| 7  | 002415 | 海康威视 | 364,015   | 12,766,006.05 | 1.59         |
| 8  | 601398 | 工商银行 | 2,137,200 | 11,904,204.00 | 1.48         |
| 9  | 000002 | 万科A  | 385,785   | 11,851,315.20 | 1.48         |
| 10 | 600276 | 恒瑞医药 | 173,660   | 11,360,837.20 | 1.42         |

**3.2 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**

| 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  | 002958 | 青农商行 | 17,700 | 134,343.00 | 0.02         |
| 2  | 603379 | 三美股份 | 2,052  | 66,546.36  | 0.01         |
| 3  | 603681 | 永冠新材 | 1,767  | 33,855.72  | 0.00         |
| 4  | 300766 | 每日互动 | 1,193  | 32,902.94  | 0.00         |
| 5  | 002952 | 亚世光电 | 514    | 25,350.48  | 0.00         |

**4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -          | -            |
| 2  | 央行票据      | -          | -            |
| 3  | 金融债券      | -          | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -          | -            |
| 4  | 企业债券      | -          | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -          | -            |
| 6  | 中期票据      | -          | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 924,000.00 | 0.12         |
| 8  | 同业存单      | -          | -            |
| 9  | 其他        | -          | -            |
| 10 | 合计        | 924,000.00 | 0.12         |

**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**

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|------------|--------------|
| 1  | 110053 | 苏银转债 | 9,240 | 924,000.00 | 0.12         |

**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**

### **9.1 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。

### **9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## **10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

### **10.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### **10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

### **10.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 11 投资组合报告附注

### 11.1 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、处罚的情形。

1、上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”，股票代码：600000）于2018年7月26日收到中国人民银行出具的行政处罚决定书（银反洗罚决字[2018]3号）。其因未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易等事项，违反了《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条、第三十二条的规定，被人民银行处以170万元罚款。

因本报告期末浦发银行属于MSCI中国A股国际通指数成分股，而本基金采用完全复制MSCI中国A股国际通指数的方法进行组合管理，因此被动持有浦发银行。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 11.2 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未超出基金合同规定的备选股票库。

### 11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 188,502.78 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 4,997.05   |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 193,499.83 |

### 11.4 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处于转股期的可转换债券。

**11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****11.5.1 报告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的情况。

**11.5.2 报告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  | 603379 | 三美股份 | 66,546.36      | 0.01         | 新股流通受限   |

**11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。



## 十二、基金的业绩

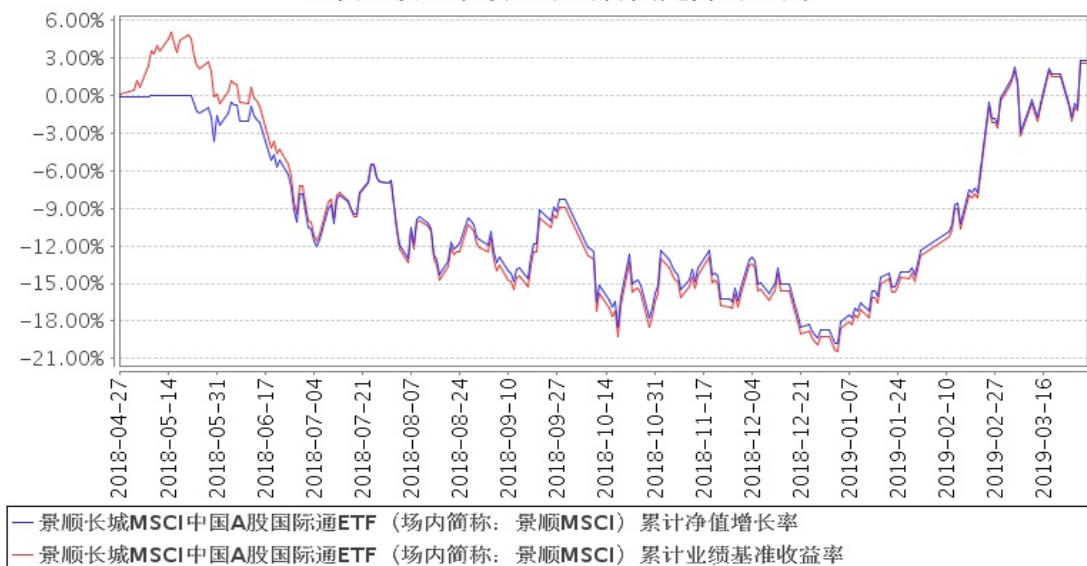
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至 2019 年 3 月 31 日。

### 1. 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段                                      | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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    |
|---|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 2018 年                                  | -18.74%  | 1.34%       | -19.28%    | 1.40%         | 0.54%  | -0.06% |
| 2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 3 月 31 日      | 26.50%   | 1.50%       | 27.09%     | 1.52%         | -0.59% | -0.02% |
| 2018 年 4 月 27 日<br>至 2019 年 3 月<br>31 日 | 2.79%    | 1.40%       | 2.59%      | 1.44%         | 0.20%  | -0.04% |

### 2. 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通 ETF (场内简称: 景顺 MSCI) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的建仓期为自 2018 年 4 月 27 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。基金合同生效日（2018 年 4 月 27 日）起至本报告期末不满一年。



### 十三、基金费用概览

#### (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、标的指数许可使用费。
- 4、基金上市费及年费。
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用。
- 6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费。
- 7、基金份额持有人大会费用。
- 8、基金的证券、期货交易费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、经纪商佣金、权证交易的结算费、证券、期货账户相关费用及其他类似性质的费用等)。
- 9、基金的银行汇划费用。
- 10、账户开户费用和账户维护费。
- 11、基金收益分配中发生的费用。
- 12、基金的登记结算费用。
- 13、基金财产投资运营过程中的增值税。
- 14、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 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金管理人与基金托管人核对后，由基金托管人于次月前 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金管理人与基金托管人核对后，由基金托管人于次月前 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

### 3、标的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。

本基金的标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.0125% 季费率计提。标的指数许可使用费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.0125\% \div \text{当季天数}$$

H 为每日应计提的标的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

标的指数许可使用费每日计提，按季支付。计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。根据基金管理人与 MSCI 公司签署的指数使用许可协议的约定，标的指数许可使用费的收取下限为每季度 5000 美元。则该下限超出正常指数许可使用费的部分（即：每季标的指数许可使用费下限—该季标的指数许可使用费）列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。此项变更无需召开基金份额持有人大会，基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—14 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。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。需要缴纳增值税的，按照税务机关的要求进行核算，从基金财产中支付，以基金管理人为增值税纳税人进行缴纳。因本基金投资运作产生的其他税收由基金财产承担。国家税收法律、法规另有规定的，从其规定。

### 十四、对招募说明书更新部分的说明

- 1、在“第三部分 基金管理人”部分，更新了基金管理人法定代表人、董事会成员、高级管理人员、基金经理、投资决策委员会委员的相关信息；
- 2、在“第四部分 基金托管人”部分，更新了托管人相关情况信息；
- 3、在“第五部分 相关服务机构”部分，更新了基金份额发售机构的相关信息；
- 4、在“第十部分 基金份额的申购与赎回”部分，更新了基金申购赎回清单的相关信息；
- 5、在“第十一部分 基金的投资”部分，更新了基金投资组合报告，数据截至 2019 年 3 月 31 日；
- 6、在“第十二部分 基金的业绩”部分，更新了基金业绩数据，数据截至 2019 年 3 月 31 日；
- 7、在“第二十三部分 对基金份额持有人的服务”部分，更新了对基金份额持有人服务的相关信息；
- 8、在“第二十四部分 其它应披露事项”部分，更新近期发布与本基金有关的公告目录，目录更新至 2019 年 4 月 27 日。

二〇一九年六月十一日