

**华夏野村日经 225 交易型开放式  
指数证券投资基金（QDII）  
招募说明书（更新）摘要**

**2019 年 10 月 21 日公告**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

## 重要提示

华夏野村日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）（以下简称“本基金”）经中国证监会 2019 年 5 月 22 日证监许可[2019]921 号文准予注册。本基金基金合同于 2019 年 6 月 12 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，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和市场前景出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金主要投资于日本证券市场，基金净值会因为日本证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、汇率风险；基金所投资的基金、股票、债券、衍生品等各种投资工具的相关风险；由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险；本基金的特定风险等。本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于跟踪标的指数的 ETF 产品，在股票基金中属于高风险等级产品。根据 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》，基金管理人和销售机构已对本基金重新进行风险评级，风险评级行为不改变基金的实质性风险收益特征，但由于风险分类标准的变化，本基金的风险等级表述可能有相应变化，具体风险评级结果应以基金管理人和销售机构提供的评级结果为准。

本基金为投资日本市场的 ETF，基金份额的清算交收和境内普通 ETF 存在一定差异，在目前的结算规则下，T 日申购的基金份额，T 日交收成功后 T+1 日可以卖出或赎回。投资者认购本基金时需具有上海证券账户，但需注意：使用基金账户只能参与本基金的现金认购和二级市场交易，如投资者需要参与基金的申购、赎回，则应使用 A 股账户。本基金以人民币募集和计价，经过换汇后主要投资于日本市场以日元计价的金融工具，人民币对日元的汇率的波动可能加大基金净值的波动，从而对基金业绩产生影响。

投资有风险，投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本摘要根据本基金的基金合同和招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，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》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者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。

本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 10 月 18 日。截至本招募说明书公告日，本基金无已披露的投资组合报告和净值表现数据。

## 一、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。

## 二、基金的投资方向

本基金主要投资于目标 ETF 基金份额，为更好地实现投资目标，基金还可投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票以及其他境内市场和境外市场依法发行的金融工具。

境内市场投资工具包括银行存款、货币市场工具（含同业存单）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。

境外市场投资工具包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(包括开放式基金和交易型开放式指数基金(ETF))；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等固定收益投资工具；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；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，可以将其纳入投资范围。

通常情况下，本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。

## 三、基金的投资策略

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。同时，为了更好地实现本基金的投资目标，本基金可适当借出证券。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 3.0%。

### 1、组合复制策略

本基金通过投资目标 ETF 实现对标的指数的跟踪，投资目标 ETF 的方式包括买卖及申赎。在满足投资比例要求的情况下，也可通过投资成份股进行组合的复制，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

## 2、替代性策略

对于出现市场流动性不足、因法律法规原因目标 ETF 或个别成份股被限制投资等情况, 导致本基金无法获得足够数量的目标 ETF 或成份股股票时, 基金管理人可以通过投资成份股、非成份股、衍生品等进行替代。

## 3、债券投资策略

结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略, 通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会, 构建收益稳定、流动性良好的债券组合。

## 4、股指期货投资策略

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, 以降低仓位调整的交易成本, 提高投资效率, 从而更好地跟踪标的指数, 实现投资目标。

## 5、股票期权投资策略

本基金投资股票期权, 将根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 充分考虑股票期权的流动性和风险收益特征, 在风险可控的前提下, 采取备兑开仓、delta 中性等策略适度参与期权投资。

## 6、融资融券投资策略

若法律法规允许, 本基金参与融资融券的情况下, 本基金将在风险可控的前提下, 本着谨慎原则, 适度参与融资融券交易。

本基金可通过选择合适的融券标的构建相应的头寸, 以调整投资组合的风险暴露, 降低系统性风险。此外, 本基金还将利用融资买入证券作为组合流动性管理工具, 提高基金的资金使用效率, 以融入资金满足基金现货交易、期货交易、赎回款支付等流动性需求。

未来, 随着证券市场投资工具的发展和丰富, 本基金可相应调整和更新相关投资策略, 并在招募说明书更新中公告。

## 四、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准: 经估值汇率调整后的日经 225 指数收益率。

若基金标的指数发生变更, 基金业绩比较基准随之变更, 基金管理人可根据投资情况和市场惯例调整基金业绩比较基准的组成和权重, 无需召开基金份额持有人大会, 但基金管理

人应取得基金托管人同意后, 并报中国证监会备案。

## 五、基金的风险收益特征

本基金属于股票基金, 风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于跟踪标的指数的 ETF 产品, 在股票基金中属于高风险等级产品。

本基金为境外证券投资的基金, 主要投资于日本证券市场中具有良好流动性的 ETF 产品。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外, 本基金还面临汇率风险、日本市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

## 六、基金管理人

### (一) 基金管理人概况

名称: 华夏基金管理有限公司

住所: 北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址: 北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

设立日期: 1998 年 4 月 9 日

法定代表人: 杨明辉

联系人: 邱曦

客户服务电话: 400-818-6666

传真: 010-63136700

华夏基金管理有限公司注册资本为 23800 万元, 公司股权结构如下:

持股单位	持股占总股本比例
中信证券股份有限公司	62.2%
POWER CORPORATION OF CANADA	13.9%
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	13.9%
天津海鹏科技咨询有限公司	10%
合计	100%

### (二) 主要人员情况

#### 1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

杨明辉先生: 董事长、党委书记, 硕士, 高级经济师。现任中信证券股份有限公司党委副书记、执行董事、总经理、执行委员会委员, 华夏基金(香港)有限公司董事长。曾任中

信证券公司董事、襄理、副总经理, 中信控股公司董事、常务副总裁, 中信信托董事, 信诚基金管理有限公司董事长, 中国建银投资证券有限责任公司执行董事、总裁等。

Barry Sean McInerney 先生: 董事, 硕士。现任万信投资公司 (Mackenzie Financial Corporation) 总裁兼首席执行官。曾在多家北美领先的金融机构担任高级管理职位。

胡祖六先生: 董事, 博士, 教授。现任春华资本集团主席, 兼任百胜中国控股有限公司非执行董事长, 香港联交所与瑞银集团等上市公司董事等。曾任国际货币基金组织高级经济学家, 达沃斯世界经济论坛首席经济学家, 高盛集团大中华区主席、合伙人、董事总经理等。

杨冰先生: 董事, 硕士。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、资产管理业务行政负责人。曾任中信证券股份有限公司固定收益部交易员、资产管理业务投资经理、资产管理业务投资主管等。

李勇进先生: 董事, 硕士。现任中信证券股份有限公司执行委员会委员、中信证券财富管理委员会主任。兼任中信期货有限公司董事、金通证券有限责任公司执行董事兼总经理。曾任中国农业银行大连市分行国际业务部科员, 申银万国证券大连营业部部门经理, 中信证券大连营业部总经理助理、副总经理、总经理, 中信证券经纪业务管理部高级副总裁、总监, 中信证券 (浙江) 有限责任公司总经理, 中信证券浙江分公司总经理, 中信证券经纪业务发展与管理委员会主任等。

李一梅女士: 董事、总经理, 硕士。兼任证通股份有限公司董事、华夏基金 (香港) 有限公司董事。曾任华夏基金管理有限公司副总经理、营销总监、市场总监、基金营销部总经理, 上海华夏财富投资管理有限公司执行董事、总经理等。

张平先生: 独立董事, 博士。现任中国社科院经济研究所研究员。兼任民生通惠资产管理公司及香港中航工业国际独立董事。曾任中国社科院经济研究所宏观研究室副主任、经济增长室主任、所长助理、副所长, 国家金融与发展实验室副主任等。

张宏久先生: 独立董事, 硕士。现任北京市竞天公诚律师事务所合伙人。兼任中信信托有限公司独立董事, 全国律师协会金融专业委员会顾问, 全国侨联法律顾问委员会委员及民事法律委员会主任, 中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、上海国际经济贸易仲裁委员会仲裁员等。

支晓强先生: 独立董事, 博士。现任中国人民大学继续教育处处长、商学院财务与金融系教授、博士生导师。兼任全国会计专业学位研究生教育指导委员会委员兼副秘书长、中国会计学会财务成本分会副会长、财政部企业会计准则咨询委员会咨询专家、中国会计学会内部控制专业委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会委员、北农大科技股份有限公司

独立董事等。

杨一夫先生：监事长，硕士。现任鲍尔太平有限公司总裁，负责总部加拿大鲍尔公司 (Power Corporation of Canada) 在中国的投资活动，兼任三川能源开发有限公司董事、中国投资协会常务理事。曾任国际金融公司 (世界银行组织成员) 驻中国的首席代表，华夏基金管理有限公司董事等。

杨维华先生：监事，硕士。现任中信证券股份有限公司风险管理部行政负责人、公司副首席风险官。曾任中信证券股份有限公司风险管理部B角 (主持工作)、总监等。

史本良先生：监事，硕士，注册会计师。现任中信证券股份有限公司计划财务部联席负责人、公司副财务总监。曾任中信证券股份有限公司计划财务部B角、总监等。

宁晨新先生：监事，博士，高级编辑。现任华夏基金管理有限公司办公室总监、董事会秘书 (兼)。曾任中国证券报社记者、编辑、办公室主任、副总编辑，中国政法大学讲师等。

陈倩女士：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司市场部执行总经理、行政负责人。曾任中国投资银行业务经理，北京证券有限责任公司高级业务经理，华夏基金管理有限公司北京分公司副总经理、市场推广部副总经理等。

朱威先生：监事，硕士。现任华夏基金管理有限公司基金运作部执行总经理、行政负责人。曾任基金运作部B角等。

张霄岭先生：副总经理，博士。现兼任华夏基金 (香港) 有限公司首席执行官、中国石化销售股份有限公司董事、清华大学五道口金融学院特聘教授。曾任美国联邦储备委员会 (华盛顿总部) 经济学家、摩根士丹利 (纽约总部) 信用衍生品交易模型风险主管、中国银监会银行监管三部副主任等。

刘义先生：副总经理，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国人民银行总行计划资金司副主任科员、主任科员，中国农业发展银行总行信息电脑部信息综合处副处长 (主持工作)，华夏基金管理有限公司监事、党办主任、养老金业务总监，华夏资本管理有限公司执行董事、总经理等。

阳琨先生：副总经理、投资总监，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员。曾任中国对外经济贸易信托投资有限公司财务部部门经理，宝盈基金管理有限公司基金经理助理，益民基金管理有限公司投资部部门经理，华夏基金管理有限公司股票投资部副总经理等。

李彬女士：督察长，硕士。现任华夏基金管理有限公司党委委员、合规部行政负责人。曾任职于中信证券股份有限公司、原中信基金管理有限责任公司。曾任华夏基金管理有限公司监察稽核部总经理助理，法律监察部副总经理、联席负责人等。



## 2、本基金基金经理

赵宗庭先生，对外经济贸易大学经济学硕士。曾任华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理、数量投资部研究员，嘉实基金管理有限公司指数投资部基金经理助理，嘉实国际资产管理有限公司基金经理。2016年11月加入华夏基金管理有限公司，现任数量投资部高级副总裁，华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2017年4月17日起任职）、华夏沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2017年4月17日起任职）、华夏野村日经225交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金经理（2019年6月12日起任职）。

## 3、本公司量化投资决策委员会

主任：张弘弢先生，华夏基金管理有限公司董事总经理，基金经理。

成员：阳琨先生，华夏基金管理有限公司副总经理、投资总监，基金经理。

徐猛先生，华夏基金管理有限公司数量投资部总监，基金经理。

宋洋女士，华夏基金管理有限公司数量投资部总监，基金经理。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 七、基金的名称

本基金名称：华夏野村日经 225 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）。

## 八、基金的类型

本基金类型：交易型开放式。

## 九、基金份额的上市交易

### （一）基金份额的上市

经向上海证券交易所申请，本基金自 2019 年 6 月 25 日起在上海证券交易所上市交易。

（交易简称：日经 ETF，交易代码：513520）

### （二）基金份额的上市交易

基金份额在上海证券交易所的上市交易，应遵照《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定。

### （三）基金份额参考净值（IOPV）的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前向中证指数公司提供当日的申购赎回清单, 中证指数公司在开市后根据申购赎回清单、日本市场实时行情以及汇率公允价, 计算并发布基金份额参考净值 (IOPV), 供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

1、基金份额参考净值计算公式为:

基金份额参考净值 = (申购赎回清单中必须用现金替代的成份证券的必须替代金额之和 + 申购赎回清单中退补现金替代的成份证券的数量与最新成交价乘积之和 + 申购赎回清单中的预估现金部分) / 最小申购、赎回单位对应的基金份额 (最新成交价按照汇率公允价调整为人民币价格)

汇率公允价包括中证指数公司在发布和计算境外指数产品中采用的实时汇率价格、基金管理人与基金托管人商定的其他公允价格 (如: 中国人民银行或国家外汇管理局或中国外汇交易中心正式对外发文后公布的北京时间 16:30 的人民币兑主要外汇当日收盘价, 如上述机构未正式发文规定公布上述收盘价, 则为中国人民银行或其授权机构最新公布的人民币汇率中间价) 等。

2、基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后 4 位。

3、基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式, 并予以公告。

(四) 停牌、复牌及终止上市交易

基金份额在上海证券交易所的停牌、复牌及终止上市交易, 应遵照《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定。

若本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的, 本基金将由交易型开放式基金变更为跟踪标的指数的非上市的开放式基金, 而无需召开基金份额持有人大会。基金变更的具体安排见基金管理人届时发布的相关公告。

(五) 相关法律法规、中国证监会及上海证券交易所对基金上市交易、申购赎回的规则等相关规定及业务规则内容进行调整的, 本基金合同相应予以修改, 并按照新规定执行, 且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

(六) 若上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能, 基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

## 十、费用概览

### (一) 基金运作费用

#### 1、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 (含境外托管人收取的费用);
- (3) 标的指数许可使用费 (包括为指数公司缴纳的相关税收以及与支付外币相关的汇兑损益、手续费、汇款费等);
- (4) 除法律法规、中国证监会另有规定外,《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审计费、会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;
- (6) 基金份额持有人大会费用;
- (7) 基金投资目标 ETF 的相关费用 (包括但不限于目标 ETF 的交易费用、申购赎回费用等);
- (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、券商佣金、权证交易的结算费、融资融券费、转融通费用、存托费、证券账户相关费用及其他类似性质的费用等);
- (9) 外汇兑换交易的相关费用;
- (10) 基金应缴纳税费, 以及与基金缴纳税收有关的手续费、汇款费、顾问费等;
- (11) 基金的银行汇划费用;
- (12) 基金上市费及年费;
- (13) 基金收益分配中发生的费用;
- (14) 基金的开销户费用、账户维护费用、以及因开销户发生的翻译费、公证费、领事认证费;
- (15) 其他为基金的利益而产生的费用, 如代表基金投票产生的费用、与基金有关的追索费等;
- (16) 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。

#### 2、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

本基金管理费按前一日基金资产净值的 0.22% 年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提, 按月支付。

由基金托管人根据与基金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。费用自动扣划后, 基金管理人应进行核对, 如发现数据不符, 及时联系基金托管人协商解决。

### (2) 基金托管人的托管费

本基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 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

基金托管费每日计提, 按月支付。

由基金托管人根据与基金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。费用自动扣划后, 基金管理人应进行核对, 如发现数据不符, 及时联系基金托管人协商解决。

### (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签署的指数使用许可协议的约定从基金财产中支付。

标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.002% 的年费率计提。标的指数许可使用费计算方法如下:

$$H = E \times 0.002\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值。

标的指数许可使用费每日计算, 按年支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后, 由基金托管人于次月首日起发送划款指令, 基金托管人复核后于次月前 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等, 支付日期顺延。

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。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。

(4) 本条第 (一) 款第 1 项 (4) 至 (16) 小项费用, 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。

### 3、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。

### (二) 基金销售费用

投资者在申购或赎回基金份额时, 申购赎回代理机构可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金, 其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用。

### (三) 税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体, 其纳税义务按国家和境外市场所在地的税收法律、法规执行。除因基金管理人与托管人疏忽、故意行为导致的基金在税收方面造成的损失外, 基金管理人与托管人不承担责任。

## 十一、基金托管人

### (一) 基金托管人情况

#### 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: 人民币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：010-67595096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2018 年末，集团资产规模 23.22 万亿元，较上年增长 4.96%。2018 年度，集团实现净利润 2,556.26 亿元，较上年增长 4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13% 和 14.04%；不良贷款率 1.46%，保持稳中有降；资本充足率 17.19%，保持领先同业。

2018 年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018 年中国最佳大型零售银行奖”、“2018 年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018 最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018 年金龙奖一年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018 年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会 2018 年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等 11 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。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

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，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、营业部并担任副行长，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。

原玎, 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、存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”。

#### (二) 基金托管人的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

作为基金托管人, 中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定, 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

中国建设银行设有风险与内控管理委员会, 负责全行风险管理与内部控制工作, 对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作, 具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### 3、内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、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; 业务管理严格实行复核、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。

#### (三) 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

##### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定, 监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”, 严格按照现行法律法规以及基金合同规定, 对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中, 对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

##### 2、监督流程

(1) 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统, 对各基金投资运作比例控制等情况进行监控, 如发现投资异常情况, 向基金管理人进行风险提示, 与基金管理人进行情况核实, 督促其纠正, 如有重大异常事项及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的划款指令后, 对指令要素等内容进行核查。

(3) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易, 电话或书面要求基金管理人进行解释或举证, 如有必要将及时报告中国证监会。

## 十二、境外托管人

### (一) 境外托管人基本情况

名称: 布朗兄弟哈里曼公司 (Brown Brothers Harriman & Co.,)



注册地址: 140 Broadway, New York, New York, U.S.A.

办公地址: 140 Broadway, New York, New York, U.S.A.

法定代表人: William B. Tyree (Managing Partner)

成立时间: 1818 年

总资产 (截至 2018 年 12 月 31 日): 70.9 亿美元

实收资本 (截至 2018 年 12 月 31 日): 9.85 亿美元

托管资产规模 (截至 2018 年 12 月 31 日): 4.7 万亿美元

信用等级: BBH 的惠誉长期评级为 A+, 短期评级为 F1

## (二) 境外托管人职责

- 1、安全保管基金的境外资产, 及时办理清算、交割事宜。
- 2、准时将公司行为信息通知基金管理人和/或基金托管人, 确保基金及时收取所有应得收入。
- 3、其他由基金托管人委托其履行的职责。

## 十三、相关服务机构

### (一) 销售机构

#### 1、申购赎回代办证券公司

##### (1) 国泰君安证券股份有限公司

住所: 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

电话: 021-38676161

传真: 021-38670161

联系人: 芮敏祺

网址: [www.gtja.com](http://www.gtja.com)

客户服务电话: 95521

##### (2) 中信建投证券股份有限公司

住所: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址: 北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：95587

传真：010-65182261

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

(3) 国信证券股份有限公司

住所：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

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

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：李颖

网址：www.guosen.com.cn

客户服务电话：95536

(4) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：黄健

网址：www.newone.com.cn

客户服务电话：95565

(5) 广发证券股份有限公司

住所：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼 (4301-4316 房)

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

电话：020-87555888

传真：020-87555417

联系人：黄岚

网址: [www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

客户服务电话: 95575 或致电各地营业网点

(6) 中信证券股份有限公司

住所: 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

电话: 010-60838888

传真: 010-60836029

联系人: 郑慧

网址: [www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

客户服务电话: 95548

(7) 中国银河证券股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 35 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

电话: 010-66568430

传真: 010-66568990

联系人: 田薇

网址: [www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

客户服务电话: 4008-888-888 或 95551

(8) 申万宏源证券有限公司

住所: 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 (200031)

法定代表人: 李梅

电话: 021-33389888

传真: 021-33388224

联系人: 陈宇

网址: [www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

客户服务电话: 95523、400-889-5523

(9) 长江证券股份有限公司

住所：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：杨泽柱

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

客户服务电话：95579、400-888-8999

(10) 西南证券股份有限公司

住所：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：廖庆轩

电话：023-67616310

传真：023-63786212

联系人：周青

网址：[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)

客户服务电话：400-809-6096

(11) 湘财证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：孙永祥

电话：021-38784580-8918

传真：021-68865680

联系人：李欣

网址：[www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)

客户服务电话：95351

(12) 华泰证券股份有限公司

住所：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、深圳市福田区深南大道 4011

号港中旅大厦 18 楼

法定代表人：周易

电话：0755-82492193

传真：0755-82492962（深圳）

联系人：庞晓芸

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

客户服务电话：95597

（13）中信证券（山东）有限责任公司

住所：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：山东省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：姜晓林

电话：0531-89606165

传真：0532-85022605

联系人：刘晓明

网址：<http://sd.citics.com>

客户服务电话：95548

（14）东吴证券股份有限公司

住所：苏州工业园区翠园路 181 号

办公地址：苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

联系人：方晓丹

网址：[www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

客户服务电话：95330

（15）方正证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

电话：0731-85832503

传真：0731-85832214

联系人: 郭军瑞

网址: [www.foundersc.com](http://www.foundersc.com)

客户服务电话: 95571

(16) 长城证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、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 14、16、17 层

法定代表人: 黄耀华

电话: 0755-83516089

传真: 0755-83515567

联系人: 李春芳

网址: [www.cgws.com](http://www.cgws.com)

客户服务电话: 400-666-6888、0755-33680000

(17) 光大证券股份有限公司

住所: 上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 薛峰

电话: 021-22169081

传真: 021-22169134

联系人: 刘晨

网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

客户服务电话: 95525、400-888-8788

(18) 广州证券股份有限公司

住所: 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

办公地址: 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层

法定代表人: 邱三发

电话: 020-88836999-5408

传真: 020-88836654

联系人: 梁微

网址: [www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

客户服务电话: 95396

(19) 国联证券股份有限公司

住所: 无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦

办公地址: 无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦

法定代表人: 姚志勇

电话: 0510-82831662

传真: 0510-82830162

联系人: 祁昊

网址: [www.glsc.com.cn](http://www.glsc.com.cn)

客户服务电话: 95570

(20) 平安证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址: 深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人: 谢永林

电话: 021-38631117

传真: 021-33830395

联系人: 石静武

网址: [www.pingan.com](http://www.pingan.com)

客户服务电话: 95511-8

(21) 华安证券股份有限公司

住所: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人: 章宏韬

电话: 0551-65161666

传真: 0551-65161600

联系人: 范超

网址: [www.hazq.com](http://www.hazq.com)

客户服务电话: 95318

(22) 国都证券股份有限公司

住所: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层、10 层

办公地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层、10 层

法定代表人： -

电话： 010-84183389

传真： 010-84183311-3389

联系人： 黄静

网址： [www.guodu.com](http://www.guodu.com)

客户服务电话： 400-818-8118

(23) 东海证券股份有限公司

住所： 江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址： 上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人： 赵俊

电话： 021-20333333

传真： 021-50498825

联系人： 王一彦

网址： [www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

客户服务电话： 95531、400-888-8588

(24) 恒泰证券股份有限公司

住所： 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址： 内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人： 庞介民

电话： 021-68405273

传真： 021-68405181

联系人： 张同亮

网址： [www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn)

客户服务电话： 400-196-6188

(25) 国盛证券有限责任公司

住所： 南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦

办公地址： 江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行大楼

法定代表人： 徐丽峰

电话： 0791-86283372、15170012175

传真： 0791-86281305



联系人: 占文驰

网址: [www.gszq.com](http://www.gszq.com)

客户服务电话: 956080

(26) 申万宏源西部证券有限公司

住所: 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 (830002)

法定代表人: 韩志谦

电话: 0991-2307105

传真: 0991-2301927

联系人: 王怀春

网址: [www.hysec.com](http://www.hysec.com)

客户服务电话: 400-800-0562

(27) 中泰证券股份有限公司

住所: 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

电话: 021-20315290

传真: 021-20315125

联系人: 许曼华

网址: [www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

客户服务电话: 95538

(28) 德邦证券股份有限公司

住所: 上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址: 上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人: 姚文平

电话: 021-68761616-8076

传真: 021-68767032

联系人: 刘熠

网址: [www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn)

客户服务电话: 400-888-8128

(29) 财通证券股份有限公司

住所: 杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址: 杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人: 沈继宁

电话: 0571-87925129

传真: 0571-87818329

联系人: 夏吉慧

网址: [www.ctsec.com](http://www.ctsec.com)

客户服务电话: 95336

(30) 中国中投证券有限责任公司

住所: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层

01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址: 深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人: 高涛

电话: 0755-88320851

传真: 0755-82026942

联系人: 胡芷境

网址: [www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

客户服务电话: 400-600-8008、95532

(31) 西藏东方财富证券股份有限公司

住所: 拉萨市北京中路 101 号

办公地址: 上海市永和路 118 弄东方企业园 24 号

法定代表人: 贾绍君

电话: 021-36533016

传真: 021-36533017

联系人: 王伟光

网址: <http://www.18.cn>

客户服务电话: 95357

(32) 国金证券股份有限公司

住所：成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

电话：028-86690057、028-86690058

传真：028-86690126

联系人：刘婧漪、贾鹏

网址：www.gjzq.com.cn

客户服务电话：95310

2、基金管理人可根据情况变更或增减申购赎回的销售机构，并在基金管理人网站公示。

基金销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点。

#### (二) 登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：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：陈文祥

电话：021-68429095

传真：021-68870311

#### (三) 律师事务所

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层

法定代表人：朱小辉

联系电话：010-57763888

传真：010-57763777

联系人：李晗

经办律师：吴冠雄、李晗

#### (四) 会计师事务所

本公司聘请的法定验资机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

法定代表人：毛鞍宁

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：徐艳

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他法律法规的要求，对本基金原招募说明书或招募说明书（更新）进行了更新，本次重大更新事项为依据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订“基金信息披露”章节及相关内容，并对包括但不限于基金管理人、基金托管人等其他信息一并更新。主要更新内容如下：

（一）根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及修订的基金合同更新“重要提示”、“绪言”、“释义”等章节中《信息披露办法》的名称、新增有关产品资料概要的释义与相关内容。

（二）根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及修订的基金合同更新“基金的信息披露”章节。

（三）根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及修订的基金合同更新全文中有关信息披露文件备案的描述。

（四）更新“基金管理人信息”、“基金托管人信息”、“基金销售机构及相关服务机构”、“基金合同的内容摘要”、“基金托管协议的内容摘要”、“其他应披露事项”。

华夏基金管理有限公司  
二〇一九年十月二十一日