

新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年十月二十五日

§1 重要提示

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本基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华 MSCI 中国 A 股国际 ETF
场内简称	MSCI 新华
基金主代码	512920
交易代码	512920
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 7 日
报告期末基金份额总额	7,092,640.00 份
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，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金投资策略包括股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略及融资及转融通证券出借。 本基金采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准

	<p>权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。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正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p>
业绩比较基准	<p>本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为 MSCI 中国 A 股国际指数。</p>
风险收益特征	<p>本基金属股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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。</p>
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“MSCI新华”，扩位证券简称“MSCIETF新华”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
--------	-----

	(2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	105,490.05
2.本期利润	-1,545,751.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2179
4.期末基金资产净值	10,529,655.34
5.期末基金份额净值	1.4846

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

3、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如基金申购费赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	-12.80%	0.87%	-13.94%	0.91%	1.14%	-0.04%
过去六个月	-6.56%	1.17%	-8.04%	1.22%	1.48%	-0.05%
过去一年	-18.98%	1.14%	-20.44%	1.19%	1.46%	-0.05%
过去三年	23.34%	1.23%	10.14%	1.27%	13.20%	-0.04%
自基金合同生效起至今	48.46%	1.23%	29.85%	1.28%	18.61%	-0.05%

注：1、本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为MSCI 中国A股国际指数。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 11 月 7 日至 2022 年 9 月 30 日)



注：报告期内本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邓岳	本基金基金经理，新华中证环保产业指数证券投资基金基金经理、新华	2018-11-07	-	14	信息与信号处理专业硕士，历任北京红色天时金融科技有限公司量化研究员，国信证券股份有限公司量化研究员，光大富尊投资有限公司量化研究员、投资经理，盈融达投资（北京）有限公司投资经理。

	MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。				
武磊	本基金基金经理，新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、新华万银	2021-01-05	-	8	工商管理硕士，历任中信保诚人寿资产管理中心投资经理助理；曾任职于嘉实基金管理有限公司人工智能研究部，从事智能量化投资策略研究工作。

	多元策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。				
--	--	--	--	--	--

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》、《基金从业人员管理规则》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订），公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理办法》，以避免出现不正当关联

交易、利益输送等违法违规行为。该办法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

公司通过合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，使各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”作为交易执行的公平原则，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。

本报告期内，公平交易管理执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一段时间是否存在违反公平交易原则的异常情况，未发现重大异常情况，且不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为指数基金，以对标的指数的有效跟踪为投资目标。

2022 年三季度，本基金采用完全复制的被动式指数投资方法，避免不必要的交易，产品紧密跟踪了指数的走势，保持了较小的跟踪误差。报告期内，标的指数发生一次成分股定期调整，本基金根据成份股及其权重的变动，在有效地控制了跟踪误差的情况下，平稳地完成了调整。

未来本基金将延续同样的被动投资策略，紧跟标的指数，争取维持与指数较小的偏离度。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.4846 元，本报告期份额净值累计增长率为-12.80%，同期比较基准的增长率为-13.94%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本基金从 2022 年 07 月 01 日至 2022 年 9 月 30 日连续六十五个工作日基金持有人低于 200 人，从 2022 年 07 月 01 日至 2022 年 9 月 30 日连续六十五个工作日基金资产净值低于五千万万元。

我司将通过多方面的措施促进本基金的规模增长，具体经营计划如下：

（一）与主要销售机构合作制定销售计划，以重点地区为主，将公司的资源向重点地区倾斜。

（二）进一步加强与潜在销售机构的合作，拓宽渠道和客户资源。

（三）采用新客户开发与老客户深入挖掘并重的客户开发方式。

（四）加强投资者教育，引导投资者充分认识产品的风险收益特点。综上所述，本基金为我司产品线主要组成部分。受市场环境的影响，本基金规模出现缩减。我司将在做好基金日常投资运营的同时，加大持续营销工作投入，同时探索其他方式和手段，尽力提升基金规模。

§5 投资组合报告

5.1 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	10,072,385.85	95.21
	其中：股票	10,072,385.85	95.21
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	506,507.07	4.79

7	其他各项资产	92.59	0.00
8	合计	10,578,985.51	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而5.2的合计项中不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	138,036.72	1.31
B	采矿业	453,582.85	4.31
C	制造业	5,847,769.57	55.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	363,045.61	3.45
E	建筑业	185,666.51	1.76
F	批发和零售业	122,574.24	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	353,846.50	3.36
H	住宿和餐饮业	17,947.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	292,009.01	2.77
J	金融业	1,732,142.81	16.45
K	房地产业	193,648.20	1.84
L	租赁和商务服务业	130,577.00	1.24
M	科学研究和技术服务业	90,194.20	0.86
N	水利、环境和公共设施管理业	21,655.10	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	77,047.13	0.73
R	文化、体育和娱乐业	37,749.40	0.36
S	综合	14,894.00	0.14
	合计	10,072,385.85	95.66

5.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资。

5.3 报告期末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

5.3.1 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	300	561,750.00	5.33
2	300750	宁德时代	600	240,534.00	2.28
3	600036	招商银行	5,400	181,710.00	1.73
4	000858	五粮液	1,000	169,230.00	1.61
5	600900	长江电力	6,023	136,963.02	1.30
6	002594	比亚迪	500	126,005.00	1.20
7	601318	中国平安	2,900	120,582.00	1.15
8	600809	山西汾酒	360	109,040.40	1.04
9	601888	中国中免	500	99,125.00	0.94
10	601012	隆基绿能	1,969	94,334.79	0.90

5.3.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 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。

5.5 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。

5.6 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。

5.7 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投资。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金合同无国债期货投资政策。

5.10.2 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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、“招商银行”发行人招商银行股份有限公司：因监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送 13 项违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会对其处以罚款 300 万元。（银保监罚决字〔2022〕21 号，2022 年 3 月 21 日）

2、“比亚迪”发行人比亚迪股份有限公司于 2022 年 6 月 7 日，被江苏省消费者权益保护委员会就“新能源汽车行业不公平格式条款”的最新情况及后续整改落实问题进行约谈。

本公司对以上证券的投资决策符合法律法规及公司制度的相关规定,不存在损害基金份额持

有人利益的行为。

本报告期末本基金投资的其他前十名证券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。

5.11.2 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

本报告期内,本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	92.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	92.59

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	7,092,640.00
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,092,640.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220701-20220930	2,733,240.00	111,200.00	12,500.00	2,831,940.00	39.93%
其他	1	20220701-20220930	3,334,200.00	100.00	67,100.00	3,267,200.00	46.06%
产品特有风险							
<p>(1) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险：标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。</p> <p>(2) 标的指数波动的风险：标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。</p> <p>(3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险：作为完全跟踪标的指数表现的指数化投资，ETF的投资风险主要是基金份额净值增长率与标的指数增长率偏离的风险，以下因素可能使基金投</p>							

投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离。

1) 由于标的指数调整成份股或变更编制方法, 使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差;

2) 由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化, 使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差;

3) 由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差;

4) 由于基金投资过程中的证券交易成本, 以及基金管理费和托管费的存在, 使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度和跟踪误差;

5) 在本基金指数化投资过程中, 基金管理人的管理能力, 例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等, 都会对本基金的收益产生影响, 从而影响本基金对标的指数的跟踪程度;

6) 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制, 基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同; 因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大; 因基金申购与赎回带来的现金变动; 因指数发布机构指数编制错误等, 由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

(4) 标的指数变更的风险: 尽管可能性很小, 但根据基金合同规定, 如出现变更标的指数的情形, 本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变, 投资组合将随之调整, 基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致, 投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

(5) 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险: 尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内, 但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响, 存在不同于基金份额净值的情形, 即存在价格折溢价的风险。

(6) 参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险: 中证指数公司计算并通过上海证券交易所发布基金份额参考净值 (IOPV), 供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异, IOPV 计算也可能出现错误。投资人若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失, 需投资人自行承担。

(7) 退市风险: 因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市, 或被基金份额持有人大会决议提前终止上市, 导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

(8) 投资人申购失败的风险: 如果投资者申购时未能提供符合要求的申购对价, 或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资者的申购申请, 则投资者的申购申请失败。

(9) 投资人赎回失败的风险: 如果投资人提出场内份额赎回申请时持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金, 或者基金投资组合中不具备足额的符合要求的赎回对价, 或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资者的场内份额赎回申请, 则投资者的场内份额赎回申请失败。基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购、赎回单位, 由此可能导致投资人按原最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额, 可能无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回。

(10) 退补现金替代方式的风险: 本基金“退补现金替代”方式不同于其他现金替代方式, 可能给申购和赎回投资人带来价格的不确定性, 从而间接影响本基金二级市场价格的折溢价水平。极端情况下, 如果使用“退补现金替代”证券的权重增加, 该方式带来的不确定性可能导致本基金的第二市场价格折溢价处于相对较高水平。基金管理人不对“时间优先、实时申报”原则的执行效率做出任何承诺和保证, 现金替代退补款的计算以实际成交价格 and 基金招募说明书的约定为准。若因技术系统、通讯联络或其他原因导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则对“退补现金替代”的证券进行处理, 投资人的利益可能受到影响。

(11) 基金份额赎回对价的变现风险: 本基金赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额等。在组合证券变现过程中, 由于市场变化、部分成份股流动性差等因素, 导致投资人变现后的价值与赎

回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

(12) 第三方机构服务的风险：本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：1) 申购赎回代理券商因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资者申购赎回服务的风险。2) 登记机构可能调整结算制度，如实施货银对付制度，对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。3) 证券交易所、登记机构、基金托管人、申购赎回代理机构及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

(13) 投资股指期货的风险：本基金投资于股指期货，因此存在因投资股指期货而带来的风险：1) 基差风险：在使用股指期货对冲市场风险的过程中，基金财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而遭受基差风险。2) 系统性风险：组合现货的 β 可能不足或者过高，组合风险敞口过大，股指期货空头头寸不能完全对冲现货的风险，组合存在系统性暴露的风险。3) 保证金风险：产品的期货头寸，如果未预留足够现金，在市场出现极端情况时，可能遭遇保证金不足而被强制平仓的风险。4) 合约展期风险：组合持有的主力合约交割日临近，需要更换合约进行展期，如果合约的基差不利或流动性不足，展期会面临风险。

(14) 基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险：基金收益分配数额的确定原则为：本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

(15) 基金参与融资与转融通业务的风险：本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资及转融通业务，可能存在杠杆投资风险和对手方交易风险等融资及转融通业务特有风险。

(16) 基金参与存托凭证投资的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金之法律意见书

(三)重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的

批复

(四)《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

(五)《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

(六)更新的《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

(七)《新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要》(更新)

(八)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

(九)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(十)基金托管人业务资格批件及营业执照

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇二二年十月二十五日