

# 景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资 基金 2020 年第 2 号更新招募说明书摘要

## 重要提示

(一) 景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金(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》”)、《公开募集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 股国际通指数增强型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 5 月 25 日证监许可【2018】870 号文准予募集注册。本基金基金合同于 2018 年 7 月 10 日正式生效。

(二) 基金管理人保证招募说明书摘要的内容真实、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、收益和市场前景做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基金招募说明书、基金产品资料概要,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。

(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并不构成对本基金业绩表现的保证。

(五) 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。

(六) 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,投资者在投资本基金前,请认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件,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(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:证券市场整体环境引发的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,大量赎回或暴跌导致的流动性风险,基金投资过程中产生的操作风险,因交收违约和投资债券引发的信用风险,基金投资对象与投资策略引致的特定风险,等等。本基金是一只股票指数增强型基金,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。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本基金的实质性风险收益特征,但由于风险等级分类标准的变化,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。

(七) 本基金投资于中小企业私募债券,该券种具有较高的流动性风险和信用风险。中小企业私募债的信用风险是指中小企业私募债券发行人可能由于规模小、经营历史短、业绩不稳定、内部治理规范性不够、信息透明度低等因素导致其不能履行还本付息的责任而使预期收益与实际收益发生偏离的可能性,从而使基金投资收益下降。基金可通过多样化投资来分散这种非系统风险,但不能完全规避。流动性风险是指中小企业私募债券由于其转让方式及其投资持有人数的限制,存在变现困难或无法在适当或期望时变现引起损失的可能性。

(八) 本基金可以投资科创板股票,会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特定风险,包括但不限于市场风险、流动性风险、退市风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

(九) 基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。

(十) 本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。

(十一) 本招募说明书已经本基金托管人复核。本基金管理人根据 2020 年 7 月 2 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理变更公告》,对本招募说明书相应做了调整,除上述事项外本招募说明书其他所载内容截止日为 2020 年 3 月 31 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 12 月 31 日。

(十二) 基金合同、招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容,自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

**基金管理人: 景顺长城基金管理有限公司**

**基金托管人: 中国建设银行股份有限公司**

## 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

成立日期：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

康乐先生，代行董事长、董事、总经理，经济学硕士。曾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。

李进先生，董事，保险学硕士。曾任中国科技财务公司信贷部农业科技信贷处副处长兼印制科技信贷处副处长、投资信贷处副处长；中国华能财务公司上海营业部副主任、综合计划部副经理、计划部副经理、综合计划部经理、公司副总经理、副总经理兼党组成员、总经理兼党组成员，永诚财产保险股份有限公司总经理、总经理兼党委委员，华能资本服务有限公司副总经理兼党组成员、总法律顾问、纪检组组长、工会主席、总经理兼党组副书记、总经理兼党委副书记。现任华能资本服务有限公司副董事长兼党委书记。

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，高级管理人员工商管理硕士。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、副总裁兼党委委员，现任长城证券股份有限公司总裁兼党委副书记。

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“毕马威会计师事务所”[KPMG]。现为“伍同明会计师事务所”所有者。

靳庆军先生，独立董事，法学硕士。曾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、亚太区首席行政官。现任景顺投资管理有限公司亚太区首席营运总监。

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

康乐先生，代行董事长职务，简历同上。

康乐先生，总经理，简历同上。

CHEN WENYU（陈文宇先生），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。

李黎女士，副总经理，经济学硕士。曾任职于广发证券深圳业务总部机构客户中心、景顺长城基金管理有限公司市场部，之后加入国投瑞银基金市场服务部

担任副总监职务。2009 年 6 月再次加入本公司，现任公司副总经理。

吴建军先生，副总经理，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。

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。

杨皦阳先生，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。

张明先生，首席信息官，工商管理硕士。曾先后担任平安证券股份有限公司信息技术部架构与开发支持组经理、信息技术中心技术开发部执行总经理等职务。2020 年 3 月加入本公司，现任公司首席信息官。

#### 4、本基金基金经理简历

徐喻军先生，理学硕士，CFA。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 10 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；2014 年 12 月至 2019 年 7 月管理景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金；2015 年 6 月至 2019 年 7 月管理景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金；2017 年 3 月至 2020 年 4 月管理景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金；2017 年 12 月至 2020 年 4 月管理景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金；2018 年 4 月至 2020 年 3 月管理景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金；2018 年 4 月至 2020 年 3 月管理景顺长

城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金；2018 年 5 月至 2019 年 11 月管理景顺长城 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；2018 年 8 月至 2019 年 11 月管理景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金；2018 年 8 月至 2019 年 11 月管理景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

#### 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、景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金、景顺长城量化先锋混合型证券投资基金和景顺长城中证沪港深红利成长低波动指数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

| 基金经理姓名 | 管理时间                           |
|--------|--------------------------------|
| 黎海威 先生 | 2018 年 7 月 10 日-2020 年 7 月 1 日 |
| 徐喻军 先生 | 2020 年 7 月 2 日-至今              |

#### 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（陈文宇先生），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；

彭成军先生，固定收益部投资总监；

李怡文女士，固定收益部稳定收益业务投资负责人；

崔俊杰先生，ETF 投资部投资总监。

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 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：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)6759 5096

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—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。

## （二）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。

原玢，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。

## （三）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

### （一）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。

### （二）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。

### （三）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

### （一）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。

(二) 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。

### 三、相关服务机构

#### (一) 基金份额发售机构

##### 1、直销中心

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

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

法定代表人：丁益

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2003]76号

电话：0755-82370388-1663

传真：0755-22381325

联系人：周婷

注：直销中心包括本公司直销柜台及直销网上交易系统/电子交易直销前置式自助前台（具体以本公司官网列示为准）

##### 2、其他销售机构

| 序号 | 销售机构全称       | 销售机构信息  |
|----|--------------|---|
| 1  | 中国建设银行股份有限公司 | 注册（办公）地址：北京市西城区金融大街25号<br>法定代表人：田国立<br>客户服务电话：95533<br>网址：www.ccb.com           |
| 2  | 中国银行股份有限公司   | 注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街1号<br>联系人：宋亚平<br>客户服务电话：95566（全国）<br>网址：www.boc.cn         |
| 3  | 中国工商银行股份有限公司 | 注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街55号<br>法定代表人：陈四清<br>客户服务电话：95588（全国）<br>网址：www.icbc.com.cn |

|   |                |  |
|---|----------------|--|
| 4 | 交通银行股份有限公司     | 办公地址：上海市银城中路 188 号<br>联系人：王菁<br>联系电话：021-58781234<br>客服电话：95559<br>公司网站：www.bankcomm.com   |
| 5 | 招商银行股份有限公司     | 注册（办公）地址：深圳市福田区深南大道 7088 号<br>法定代表人：李建红<br>联系人：邓炯鹏<br>客户服务电话：95555<br>网址：www.cmbchina.com  |
| 6 | 广发银行股份有限公司     | 注册（办公）地址：广州市越秀区东风东路 713 号<br>法定代表人：杨明生<br>客户服务电话：400 830 8003<br>网址：www.cgbchina.com.cn  |
| 7 | 上海浦东发展银行股份有限公司 | 注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号<br>办公地址：上海市中山东一路 12 号<br>法定代表人：吉晓辉<br>联系人：高天、于慧<br>电话：（021）61618888<br>传真：（021）63604199<br>客户服务热线：95528<br>公司网站：www.spdb.com.cn |
| 8 | 中国民生银行股份有限公司   | 注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号<br>法定代表人：洪崎<br>联系人：穆婷<br>联系电话：010-58560666<br>传真：010-57092611<br>客户服务热线：95568<br>网址：www.cmbc.com.cn                          |
| 9 | 平安银行股份有限公司     | 注册（办公）地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦<br>法定代表人：孙建一<br>联系人：张莉<br>电话：021-38637673<br>传真：021-50979507<br>客户服务电话：95511-3<br>网址：www.bank.pingan.com               |

|    |            |   |
|----|------------|---|
| 10 | 渤海银行股份有限公司 | <p>注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号</p> <p>办公地址：天津市河东区海河东路 218 号渤海银行大厦</p> <p>法定代表人：李伏安</p> <p>联系人：王宏</p> <p>联系电话：022-58316666</p> <p>传真：022-58316259</p> <p>客户服务热线：95541</p> <p>网址：www.cbhb.com.cn</p> |
| 11 | 嘉兴银行股份有限公司 | <p>注册（办公）地址：嘉兴市建国南路 409 号</p> <p>法定代表人：许洪明</p> <p>联系人：陈兢</p> <p>电话：0573-82082676</p> <p>传真：0573-82062161</p> <p>客户服务电话：057396528</p> <p>银行网址：www.bojx.com</p>                                   |
| 12 | 包商银行股份有限公司 | <p>注册（办公）地址：内蒙古包头市钢铁大街 6 号</p> <p>办公地址：内蒙古包头市钢铁大街 6 号</p> <p>法定代表人：李镇西</p> <p>联系人：张建鑫</p> <p>电话：010-64816038</p> <p>传真：010-84596546</p> <p>客服电话：95352</p> <p>网站：www.bsb.com.cn</p>              |
| 13 | 南京银行股份有限公司 | <p>注册（办公）地址：南京市中山路 288 号</p> <p>法定代表人：林复</p> <p>联系人：李冰洁</p> <p>电话：025-86775317</p> <p>传真：025-86775376</p> <p>客户服务电话：95302</p> <p>网址：www.njcb.com.cn</p>   |
| 14 | 苏州银行股份有限公司 | <p>注册（办公）地址：苏州工业园区钟园路 728 号</p> <p>法定代表人：王兰凤</p> <p>传真：0512-69868370</p> <p>客户服务电话：0512-96067</p> <p>网址：www.suzhoubank.com</p>  |

|    |                  |  |
|----|------------------|--|
| 15 | 上海农村商业银行股份有限公司   | 注册(办公)地址: 上海市黄浦区中山东二路 70 号<br>法定代表人: 冀光恒<br>客户服务电话: 021-962999、4006962999<br>网址: www.srcb.com  |
| 16 | 江苏江南农村商业银行股份有限公司 | 注册(办公)地址: 常州和平中路 413 号<br>法定代表人: 陆向阳<br>联系人: 蒋姣<br>电话: 0519-80585939<br>传真: 0519-89995017<br>客户服务电话: 96005<br>网址: www.jnbank.com.cn  |
| 17 | 四川天府银行股份有限公司     | 注册地址: 四川省南充市涪江路 1 号<br>办公地址: 四川省成都市锦江区下东大街 258 号<br>法定代表人: 邢敏<br>联系人: 樊海波<br>电话: 028-67676033<br>客户服务电话: 4001696869<br>网址: www.tf.cn |
| 18 | 上海银行股份有限公司       | 注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区银城中路 168 号<br>办公地址: 上海市浦东新区银城中路 168 号<br>法定代表人: 金煜<br>客户服务电话: 95594<br>网址: http://www.bosc.cn/                    |
| 19 | 江苏银行股份有限公司       | 注册(办公)地址: 南京市中华路 26 号<br>法定代表人: 夏平<br>联系人: 张洪玮<br>电话: 025-58587036<br>传真: 025-58587820<br>客户服务电话: 95319<br>网址: www.jsbchina.cn       |
| 20 | 宁波银行股份有限公司       | 注册(办公)地址: 浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号<br>联系人: 廖凯亮<br>电话: 0574-87050028<br>传真: 0574-87050027<br>客户服务电话: 95574<br>网址: www.nbcb.cn               |

|    |                  |   |
|----|------------------|---|
| 21 | 江苏苏州农村商业银行股份有限公司 | 注册（办公）地址：江苏省苏州市吴江区中山南路 1777 号<br>法定代表人：魏礼亚<br>联系人：葛晓亮<br>电话：0512-63969209<br>传真：0512-63969209<br>客户服务电话：96068<br>网址：www.szrcb.com                                       |
| 22 | 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：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦<br>法定代表人：贺青<br>联系电话：021-38676666<br>传真：021-38670666<br>联系人：钟伟镇<br>网址：www.gtja.com<br>服务热线：95521 / 4008888666 |
| 23 | 中信建投证券股份有限公司     | 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：www.csc108.com                            |
| 24 | 申万宏源证券有限公司       | 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：www.swhysc.com                             |
| 25 | 申万宏源西部证券有限公司     | 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：www.hysec.com             |

|    |              |   |
|----|--------------|---|
| 26 | 兴业证券股份有限公司   | 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：www.xyzq.com.cn                        |
| 27 | 光大证券股份有限公司   | 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<br>客户服务电话：95525、4008888788、10108998<br>网址：www.ebscn.com                          |
| 28 | 中银国际证券股份有限公司 | 注册（办公）地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 31 楼<br>法定代表人：宁敏<br>联系人：许慧琳<br>电话：021-20328531<br>客户服务电话：4006208888<br>网址：www.bocichina.com  |
| 29 | 中国国际金融股份有限公司 | 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   |
| 30 | 天相投资顾问有限公司   | 注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701<br>办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层<br>法定代表人：林义相<br>联系人：尹伶<br>电话：010-66045529<br>传真：010-66045518<br>客服热线：010-66045678<br>网址：www.txsec.com |



|    |            |  |
|----|------------|--|
| 31 | 西部证券股份有限公司 | 注册（办公）地址：西安市新城区东新街 319 号 7 幢 10000 室<br>法定代表人：徐朝晖<br>联系人：梁承华<br>联系方式：029-87211526<br>客服热线：95582<br>网址：www.westsecu.com.cn  |
| 32 | 信达证券股份有限公司 | 注册（办公）地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼<br>法定代表人：张志刚<br>联系人：唐静<br>电话：010-63081000<br>传真：010-63080978<br>客服热线：95321<br>网址：www.cindasc.com                                      |
| 33 | 国金证券股份有限公司 | 注册地址：成都市东城根上街 95 号<br>办公地址：成都市东城根上街 95 号<br>法定代表人：冉云<br>联系人：刘婧漪、贾鹏<br>电话：028-86690057、02886690058<br>传真：028-86690126<br>客服电话：95310<br>公司网站：www.gjqz.com.cn           |
| 34 | 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<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 |
| 35 | 长江证券股份有限公司 | 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                          |

|    |                |  |
|----|----------------|--|
| 36 | 中信证券（山东）有限责任公司 | 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                                     |
| 37 | 西南证券股份有限公司     | 注册（办公）地址：重庆市江北区桥北苑 8 号<br>法定代表人：吴坚<br>联系人：张煜<br>电话：023-63786141<br>传真：023-63786212<br>客服电话：400 809 6096<br>公司网站：www.swsc.com.cn  |
| 38 | 东海证券股份有限公司     | 注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层<br>办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦<br>法定代表人：钱俊文<br>电话：021-20333333<br>传真：021-50498825<br>联系人：王一彦<br>客服电话：95531；400-8888-588<br>网址：www.longone.com.cn |
| 39 | 第一创业证券股份有限公司   | 注册（办公）地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼<br>法定代表人：刘学民<br>联系人：毛诗莉<br>电话：0755-23838750<br>传真：0755-23838750<br>客服电话：400-888-1888<br>网址：www.fcsc.com                                     |
| 40 | 川财证券有限责任公司     | 注册（办公）地址：成都市高新区交子大道 177 号中海国际中心 B 座 17 层<br>法定代表人：孟建军<br>联系人：匡婷<br>电话：028-86583053<br>传真：028-86583053<br>客户服务电话：028-95105118<br>公司网址：http://www.cczq.com                       |

|    |            |  |
|----|------------|--|
| 41 | 天风证券股份有限公司 | 注册地址：湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼<br>办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼<br>法定代表人：余磊<br>联系人：崔成<br>电话：027-87610052<br>传真：027-87618863<br>客户服务电话：4008005000<br>网址：www.tfzq.com                   |
| 42 | 中信期货有限公司   | 注册（办公）地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层<br>法定代表人：张皓<br>联系人：洪诚<br>电话：0755-23953913<br>传真：0755-83217421<br>客户服务电话：400-990-8826<br>网址：www.citicsf.com                          |
| 43 | 华鑫证券有限责任公司 | 注册（办公）地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦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 |
| 44 | 联储证券有限责任公司 | 注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼<br>办公地址：北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心27层<br>法定代表人：吕春卫<br>联系人：丁倩云<br>电话：010-86499427<br>传真：010-86499401<br>客户服务电话：400-620-6868<br>网址：www.lczq.com           |

|    |                |   |
|----|----------------|---|
| 45 | 深圳众禄基金销售股份有限公司 | 注册（办公）地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼<br>法定代表人：薛峰<br>联系人：童彩平<br>电话：0755-33227950<br>传真：0755-33227951<br>客户服务电话：4006-788-887<br>网址：众禄基金网 <a href="http://www.zlfund.cn">www.zlfund.cn</a><br>基金买卖网 <a href="http://www.jjmmw.com">www.jjmmw.com</a> |
| 46 | 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司 | 注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室<br>办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F<br>法定代表人：祖国明<br>联系人：韩爱彬<br>客服电话：4000-766-123<br>公司网址： <a href="http://www.fund123.cn">www.fund123.cn</a>  |
| 47 | 诺亚正行基金销售有限公司   | 注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室<br>办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号东码头园区 C 栋<br>法定代表人：汪静波<br>联系人：李娟<br>电话：021-80358236<br>传真：021-80358749<br>客户服务电话：400-821-5399<br>网址： <a href="http://www.noah-fund.com">www.noah-fund.com</a>                        |
| 48 | 上海长量基金销售有限公司   | 注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室<br>办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层<br>法定代表人：张跃伟<br>联系人：单丙焱<br>电话：021-20691832<br>传真：021-20691861<br>客服电话：400-820-2899<br>公司网站： <a href="http://www.erichfund.com">www.erichfund.com</a>                         |

|    |                |  |
|----|----------------|--|
| 49 | 上海好买基金销售有限公司   | 注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 4494<br>办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼<br>法定代表人：杨文斌<br>联系人：张茹<br>电话：021-58870011<br>传真：021-68596916<br>客户服务电话：400 700 9665<br>网址：www.ehowbuy.com         |
| 50 | 北京展恒基金销售股份有限公司 | 注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号<br>办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号 邮电新闻大厦 6 层<br>法定代表人：闫振杰<br>联系人：李晓芳<br>联系电话：010-59601366 转 7167<br>客服电话：400-818-8000<br>公司网站：www.myfund.com                               |
| 51 | 上海天天基金销售有限公司   | 注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 东方财富大厦 2 楼<br>办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座（北楼）25 层<br>法定代表人：其实<br>联系人：潘世友<br>电话：021-54509977-8400<br>传真：021-54509953<br>客服电话：400-1818-188<br>网址：http://www.1234567.com.cn |
| 52 | 浙江同花顺基金销售有限公司  | 注册地址：浙江省杭州市文二西路一号 元茂大厦 903 室<br>法定代表人：吴强<br>联系人：洪泓<br>电话：0571-88911818-8659<br>传真：0571-86800423<br>客户服务电话：4008-773-772<br>网址：www.5ifund.com  |

|    |                  |  |
|----|------------------|--|
| 53 | 宜信普泽（北京）基金销售有限公司 | 注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809<br>办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809 室<br>法定代表人：戎兵<br>联系人：魏晨<br>电话：010-52858244<br>传真：010-59644496<br>客户服务电话：400-609-9200<br>网址：www.yixinfund.com |
| 54 | 嘉实财富管理有限公司       | 注册（办公）地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 4606-10 单元<br>法定代表人：赵学军<br>联系人：景琪<br>电话：021-20289890<br>传真：010-85097308<br>客户服务电话：400-021-8850<br>网址：www.harvestwm.cn                                     |
| 55 | 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 | 注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#<br>办公地址：北京市西城区宣武门外大街 10 号庄胜广场中央办公楼东翼 7 层<br>法定代表人：马勇<br>电话：0755-88394666<br>传真：0755-88394677<br>客户服务电话：400-166-1188<br>网址：http://8.jrj.com.cn/       |
| 56 | 北京恒天明泽基金销售有限公司   | 注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室<br>办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室<br>法定代表人：周斌<br>电话：010-59313555<br>传真：010-53509643<br>客户服务电话：400-8980-618<br>网址：www.chtwm.com           |
| 57 | 北京钱景基金销售有限公司     | 注册（办公）地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012<br>法定代表人：赵荣春<br>联系人：陈剑炜<br>电话：010-57418813<br>传真：010-57569671<br>客户服务电话：400-875-9885<br>网址：www.qianjing.com                                     |

|    |                |  |
|----|----------------|--|
| 58 | 北京创金启富投资管理有限公司 | <p>注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A<br/>                 办公地址：北京市西城区民白纸坊东街 2 号经济日报社综合楼 A 座 712 室<br/>                 法定代表人：梁蓉<br/>                 联系人：魏素清<br/>                 电话：010-66154828<br/>                 传真：010-63583991<br/>                 客户服务电话：400-6262-1818<br/>                 网址：www.5irich.com</p>   |
| 59 | 北京唐鼎耀华基金销售有限公司 | <p>注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室<br/>                 办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1505 室<br/>                 法定代表人：张冠宇<br/>                 联系人：王丽敏<br/>                 电话：010-85932810<br/>                 传真：010-85932880<br/>                 客户服务电话：400-819-9868<br/>                 网址：www.tdyhfund.com</p> |
| 60 | 上海联泰基金销售有限公司   | <p>注册地址：上海自由贸易区富特北路 277 号 3 层 310 室<br/>                 法定代表人：尹彬彬<br/>                 联系人：兰敏<br/>                 电话：021-52822063<br/>                 传真：021-52975270<br/>                 客户服务电话：400-166-6788<br/>                 网址：www.66liantai.com</p>  |
| 61 | 上海汇付基金销售有限公司   | <p>注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-5 室<br/>                 办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼<br/>                 法定代表人：张晶<br/>                 联系人：周丹<br/>                 电话：021-33323999<br/>                 传真：021-33323993<br/>                 客户服务电话：400-820-2819<br/>                 手机客户端：天天盈基金</p>                 |

|    |                |   |
|----|----------------|---|
| 62 | 北京新浪仓石基金销售有限公司 | <p>注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室<br/>                     办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院东区 3 号楼为明大厦 C 座<br/>                     法定代表人：赵芯蕊<br/>                     联系人：赵芯蕊<br/>                     电话：010-62675768<br/>                     传真：010-62676582<br/>                     客户服务电话：010-62675369<br/>                     网址：www.xincai.com</p> |
| 63 | 上海陆金所基金销售有限公司  | <p>注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元<br/>                     办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号<br/>                     法定代表人：王之光<br/>                     联系人：宁博宇<br/>                     电话：021-20665952<br/>                     传真：021-22066653<br/>                     客户服务电话：4008219031<br/>                     网址：www.lufunds.com</p>                                   |
| 64 | 北京虹点基金销售有限公司   | <p>注册地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室<br/>                     办公地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号 10 层 1015 室<br/>                     法定代表人：何静<br/>                     联系人：王重阳<br/>                     电话：010-65951887<br/>                     客户服务电话：400-618-0707<br/>                     网址：www.hongdianfund.com</p>   |
| 65 | 珠海盈米基金销售有限公司   | <p>注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491<br/>                     办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203<br/>                     法定代表人：肖雯<br/>                     联系人：黄敏嫦<br/>                     电话：020-89629099<br/>                     传真：020-89629011<br/>                     客户服务电话：020-89629066<br/>                     网址：www.yingmi.cn</p>                     |



|    |                  |  |
|----|------------------|--|
| 66 | 中证金牛（北京）投资咨询有限公司 | <p>注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室<br/>                 办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层<br/>                 法定代表人：钱昊旻<br/>                 联系人：孙雯<br/>                 电话：010-59336519<br/>                 传真：010-59336500<br/>                 客户服务电话：4008-909-998<br/>                 网址：www.jnlc.com</p>                                       |
| 67 | 奕丰基金销售有限公司       | <p>注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）<br/>                 办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室<br/>                 法定代表人：TEO WEE HOWE<br/>                 联系人：叶健<br/>                 电话：0755-89460500<br/>                 传真：0755-21674453<br/>                 客户服务电话：400-684-0500<br/>                 网址：www.ifastps.com.cn</p> |
| 68 | 和耕传承基金销售有限公司     | <p>注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503<br/>                 办公地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503<br/>                 法定代表人：王旋<br/>                 电话：0371-85518396<br/>                 传真：0371-85518397<br/>                 联系人：董亚芳<br/>                 客服热线：400-0555-671<br/>                 公司网站：www.hgccpb.com</p>                 |
| 69 | 上海凯石财富基金销售有限公司   | <p>注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室<br/>                 办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼<br/>                 法定代表人：陈继武<br/>                 联系人：李晓明<br/>                 电话：021-63333319<br/>                 传真：021-63332523<br/>                 客户服务电话：4006433389<br/>                 网址：www.vstonewealth.com</p>  |

|    |                |  |
|----|----------------|--|
| 70 | 深圳市金斧子基金销售有限公司 | <p>注册地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108</p> <p>办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层 1108</p> <p>法人代表：赖任军<br/>         联系人：刘昕霞<br/>         电话：0755-29330513<br/>         传真：0755-26920530<br/>         客服电话：400-930-0660<br/>         公司网址：www.jfzinv.com</p> |
| 71 | 武汉市伯嘉基金销售有限公司  | <p>注册（办公）地址：武汉市江汉区 17-19 号环亚大厦 B 座 601 室</p> <p>法定代表人：陶捷<br/>         联系人：陆锋<br/>         电话：027-83863742<br/>         客户服务电话：4000279899<br/>         网址：www.buyfunds.cn</p>   |
| 72 | 北京汇成基金销售有限公司   | <p>注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号</p> <p>办公地址：北京市西城区西直门外大街 1 号院 2 号楼（西环广场 B 座）19 层</p> <p>法定代表人：王伟刚<br/>         客服电话：400-619-9059<br/>         公司网址：www.hcjijin.com</p>   |
| 73 | 南京苏宁基金销售有限公司   | <p>注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号</p> <p>法定代表人：钱燕飞<br/>         联系人：王锋<br/>         电话：025-66996699-887226<br/>         传真：025-66996699<br/>         客户服务电话：95177<br/>         网址：www.snjjjin.com</p>   |
| 74 | 上海大智慧基金销售有限公司  | <p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元</p> <p>法定代表人：申健<br/>         联系人：印强明<br/>         电话：021-20219988<br/>         传真：021-20219988<br/>         客户服务电话：021-20292031<br/>         网址：https://www.wg.com.cn</p>  |

|    |                |   |
|----|----------------|---|
| 75 | 北京广源达信基金销售有限公司 | 注册地址：北京市西城区新街口外大街<br>28 号 C 座六层 605 室<br>办公地址：北京市朝阳区望京东园四区<br>13 号楼浦项中心 B 座 19 层<br>法定代表人：齐剑辉<br>联系人：王英俊<br>电话：010-57298634<br>客服电话：4006236060<br>传真：010-82055860<br>网址：www.niuniufund.com                              |
| 76 | 海银基金销售有限公司     | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验<br>区银城中路 8 号 402 室<br>办公地址：上海市浦东新区银城中路 8<br>号 4 楼<br>法定代表人：刘惠<br>联系人：毛林<br>电话：021-80133597<br>传真：021-80133413<br>客户服务电话：400-808-1016<br>网址：www.fundhaiyin.com   |
| 77 | 深圳前海微众银行股份有限公司 | 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾<br>一路 1 号 A 栋 201（入驻深圳市前海<br>商务秘书有限公司）<br>办公地址：广东省深圳市南山区沙<br>河西路 1819 号深圳湾科技生态园 7 栋<br>A 座<br>法定代表人：顾敏<br>联系人：赵云<br>电话：0755-84007736<br>传真：0755-86700688<br>客户服务电话：95384<br>网址：http://www.webank.com/ |
| 78 | 上海万得基金销售有限公司   | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验<br>区福山路 33 号 11 楼 B 座<br>办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号<br>8 楼<br>法定代表人：王廷富<br>联系人：姜吉灵<br>电话：021-5132 7185<br>传真：021-5071 0161<br>客户服务电话：400-821-0203   |

|    |                  |   |
|----|------------------|---|
| 79 | 中民财富基金销售（上海）有限公司 | <p>注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元<br/>                 办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 27 层<br/>                 法定代表人：弭洪军<br/>                 联系人：郭斯捷<br/>                 电话：021-33357030<br/>                 传真：021-63353736<br/>                 客户服务电话：400-876-5716<br/>                 网址：www.cmiwm.com</p>  |
| 80 | 北京蛋卷基金销售有限公司     | <p>注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507<br/>                 法定代表人：钟斐斐<br/>                 联系人：侯芳芳<br/>                 电话：010-61840688<br/>                 传真：010-84997571<br/>                 客服电话：400-159-9288<br/>                 官网：<a href="https://danjuanapp.com">https://danjuanapp.com</a></p>   |
| 81 | 上海基煜基金销售有限公司     | <p>注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）<br/>                 办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室<br/>                 法定代表人：王翔<br/>                 联系人：蓝杰<br/>                 电话：021-65370077<br/>                 传真：021-55085991<br/>                 客户服务电话：4008205369<br/>                 网址：www.jiyufund.com.cn</p>                                     |
| 82 | 上海钜派钰茂基金销售有限公司   | <p>注册地址：上海市浦东新区泥城镇新城路 2 号 24 幢 N3187 室<br/>                 办公地址：上海市浦东新区浦东南路 379 号金穗大厦 14 楼 C 座<br/>                 法定代表人：杨雅琴<br/>                 联系人：卢奕<br/>                 电话：021-68670358<br/>                 传真：021-68413161<br/>                 客户服务电话：4006889967<br/>                 网址：<a href="http://www.jp-fund.com/">http://www.jp-fund.com/</a></p> |

|    |                  |  |
|----|------------------|--|
| 83 | 凤凰金信（银川）基金销售有限公司 | <p>注册地址：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402</p> <p>办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院朝来高科技产业园 18 号楼</p> <p>法定代表人：张旭</p> <p>联系人：陈旭</p> <p>电话：010-58160168</p> <p>传真：010-58160173</p> <p>客户服务电话：400-810-5919</p> <p>网址：www.fengfd.com</p>                 |
| 84 | 北京肯特瑞基金销售有限公司    | <p>注册地址：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157</p> <p>办公地址：北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 15 层</p> <p>法定代表人：王苏宁</p> <p>电话：95118</p> <p>传真：010-89189566</p> <p>客服热线：95118</p> <p>公司网站：kenterui.jd.com</p>   |
| 85 | 上海挖财基金销售有限公司     | <p>注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼 01、02、03 室</p> <p>办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 楼 01、02、03 室</p> <p>法定代表人：胡燕亮</p> <p>联系人：义雪辉</p> <p>电话：021 - 50810687</p> <p>传真：021-58300279</p> <p>客户服务电话：021-50810673</p> <p>网址：www.wacaijijin.com/</p> |
| 86 | 北京百度百盈基金销售有限公司   | <p>注册地址：北京市海淀区上地十街 10 号 1 幢 1 层 101</p> <p>办公地址：北京市海淀区上地信息路甲 9 号奎科科技大厦</p> <p>法定代表人：张旭阳</p> <p>联系人：孙博超</p> <p>电话：010-61952703</p> <p>传真：010-61951007</p> <p>客户服务电话：95055</p> <p>网址：www.baiyingfund.com</p>                                     |

|    |                       |  |
|----|-----------------------|--|
| 87 | <p>玄元保险代理有限公司</p>     | <p>注册（公告）地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室<br/>                     法定代表人：马永谔<br/>                     联系人：卢亚博<br/>                     电话：13752528013<br/>                     传真：021-50701053<br/>                     客户服务电话：021-50701053<br/>                     网址：<br/> <a href="http://www.xyinsure.com:7100/kfit_xyb">http://www.xyinsure.com:7100/kfit_xyb</a><br/>                     x</p>           |
| 88 | <p>上海陆亨基金销售有限公司</p>   | <p>注册地址：上海市浦东新区南汇新城镇环湖西二路 888 号 1 幢 1 区 14032 室<br/>                     办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇广场 2 座 16 楼<br/>                     法定代表人：陈志英<br/>                     联系人：韦巍<br/>                     电话：400-168-1235<br/>                     传真：021-53398801<br/>                     客户服务电话：400-168-1235<br/>                     网址：<a href="http://www.luxxfund.com/">http://www.luxxfund.com/</a></p> |
| 89 | <p>江苏汇林保大基金销售有限公司</p> | <p>注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号<br/>                     办公地址：南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室<br/>                     法定代表人：吴言林<br/>                     联系人：林伊灵<br/>                     电话：025-66046166<br/>                     传真：025-56878016<br/>                     客户服务电话：025-66046166<br/>                     网址：<a href="http://www.huilinbd.com">http://www.huilinbd.com</a></p>                          |
| 90 | <p>中国人寿保险股份有限公司</p>   | <p>注册（办公）地址：中国北京市西城区金融大街 16 号<br/>                     法定代表人：王滨<br/>                     客户服务电话：95519<br/>                     网址：<a href="http://www.e-chinalife.com">www.e-chinalife.com</a></p>   |

|    |                  |  |
|----|------------------|--|
| 91 | 鼎信汇金（北京）投资管理有限公司 | 注册（办公）地址：北京市海淀区太月园 3 号楼 5 层 521 室<br>法定代表人：齐凌峰<br>联系人：陈臣<br>电话：010-82098631<br>传真：010-82086110<br>客户服务电话：400-158-5050<br>网址：www.9ifund.com |
|----|------------------|--|

各销售机构的具体名单见基金份额发售公告。基金管理人可根据《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

## （二）登记机构

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  
 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  
 法定代表人：丁益  
 电话：0755-82370388-1646  
 传真：0755-22381325  
 联系人：邹昱

## （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

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

联系电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

经办注册会计师：单峰、陈薇瑶

#### 四、基金的名称

景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金

#### 五、基金的类型

契约型开放式

#### 六、基金的投资目标

本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。

#### 七、基金的投资方向

本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。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分股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（权证、股指期货等）、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、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款，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）。

基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资



于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

## 八、基金的投资策略

### 1、资产配置策略

本基金为指数基金，股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。

### 2、股票投资策略

本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。

#### (1) 指数化被动投资策略

指数化被动投资策略参照标的指数的成分股、备选成分股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出相应调整，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不得超过 7.75%。

#### (2) 量化增强策略

量化增强策略主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，产出投资组合，以追求超越标的指数表现的业绩水平。

超额收益模型：该模型通过构建多因子量化系统，综合评估估值、市场趋势、盈利、企业质量、投资者情绪等多个因素，以自下而上为主，自上而下为辅，分辨

各类资产和各证券之间的定价偏差。定价偏低的资产具有投资价值，定价过高的资产应当考虑回避。

风险模型:该模型控制投资组合对各类风险因子的敞口，包括基金规模、资产波动率、行业集中度等，力求主动风险以及跟踪误差控制在目标范围内。

成本模型:该模型根据各类资产的市场交易活跃度、市场冲击成本、印花税、佣金等数据预测本基金的交易成本，能有效控制基金的换手率。

### 3、债券投资策略

出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。

### 4、权证、股指期货投资策略

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，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

### 5、中小企业私募债券的投资策略

对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金会加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。

### 6、资产支持证券投资策略

本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，基金管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，考虑选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

## 九、业绩比较基准

MSCI 中国 A 股国际通指数收益率  $\times 95\%$  + 商业银行活期存款利率(税后)  $\times 5\%$   
本基金为指数增强型基金，标的指数为 MSCI 中国 A 股国际通指数，因此业绩比较基准以 MSCI 中国 A 股国际通指数收益率为主要组成部分。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时，本基金管理人协商基金托管人后可以在报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召开基金份额持有人大会。

## 十、风险收益特征

本基金是一只股票指数增强型基金，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。

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本基金的实质性风险收益特征，但由于风险等级分类标准的变化，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。

## 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。

基金托管人中国建设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 12 月 31 日。

**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              | 101,963,937.12 | 90.56        |
|    | 其中：股票             | 101,963,937.12 | 90.56        |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | -              | -            |
|    | 其中：债券             | -              | -            |
|    | 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      | 10,464,489.31  | 9.29         |
| 8  | 其他资产              | 170,265.76     | 0.15         |
| 9  | 合计                | 112,598,692.19 | 100.00       |

**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         | 4,862,492.24  | 4.46         |
| B  | 采矿业              | 2,598,560.00  | 2.38         |
| C  | 制造业              | 36,922,428.94 | 33.85        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,414,998.00  | 1.30         |
| E  | 建筑业              | 4,057,741.56  | 3.72         |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 462,903.30    | 0.42         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,343,205.00  | 1.23         |
| J  | 金融业              | 22,777,545.57 | 20.89        |
| K  | 房地产业             | 5,579,899.00  | 5.12         |
| 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   | 3,110,904.30  | 2.85  |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,054,775.00  | 0.97  |
| S | 综合        | -             | -     |
|   | 合计        | 84,185,452.91 | 77.19 |

## 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              | 1,921,219.60  | 1.76         |
| C  | 制造业              | 10,813,060.28 | 9.91         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 337,125.00    | 0.31         |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 219,450.00    | 0.20         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 35,744.00     | 0.03         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 349,035.00    | 0.32         |
| J  | 金融业              | 333,207.00    | 0.31         |
| K  | 房地产业             | 1,115,374.00  | 1.02         |
| 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    | 832,968.04    | 0.76         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | 271,776.00    | 0.25         |
| Q  | 卫生和社会工作          | -             | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 1,549,525.29  | 1.42         |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 17,778,484.21 | 16.30        |

## 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  | 601318 | 中国平安 | 68,450  | 5,849,737.00 | 5.36         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 4,604   | 5,446,532.00 | 4.99         |
| 3  | 000858 | 五粮液  | 24,200  | 3,218,842.00 | 2.95         |
| 4  | 601377 | 兴业证券 | 437,900 | 3,100,332.00 | 2.84         |
| 5  | 600036 | 招商银行 | 75,020  | 2,819,251.60 | 2.59         |
| 6  | 000568 | 泸州老窖 | 31,727  | 2,750,096.36 | 2.52         |
| 7  | 601998 | 中信银行 | 438,000 | 2,702,460.00 | 2.48         |
| 8  | 600606 | 绿地控股 | 384,683 | 2,673,546.85 | 2.45         |
| 9  | 600346 | 恒力石化 | 155,840 | 2,505,907.20 | 2.30         |
| 10 | 300498 | 温氏股份 | 70,300  | 2,362,080.00 | 2.17         |

#### 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  | 000708 | 中信特钢 | 57,600  | 1,320,768.00 | 1.21         |
| 2  | 601928 | 凤凰传媒 | 160,443 | 1,220,971.23 | 1.12         |
| 3  | 600307 | 酒钢宏兴 | 587,400 | 1,210,044.00 | 1.11         |
| 4  | 000739 | 普洛药业 | 88,300  | 1,145,251.00 | 1.05         |
| 5  | 601058 | 赛轮轮胎 | 230,700 | 1,031,229.00 | 0.95         |

### 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**

### **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，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，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**

**11.1.1 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、招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”，股票代码：600036）于 2019 年 7 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具的行政处罚决定书（沪银保监银罚决字〔2019〕51 号）。其信用卡中心因在为部分客户办理信用卡业务时，未遵守总授信额度管理制度的问题，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项的相关规定，被处以罚款人民币 20 万元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对招商银行进行了投资。

2、中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”，股票代码：601998）于 2019 年 8 月 9 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书（银保监罚决字〔2019〕12 号）。其因未按规定提供报表且逾期未改正；错报、漏报银行业监管统计资料；未向监管部门报告重要信息系统运营中断事件等多项问题，违反了《银行业监管统计管理暂行办法》（中国银监会令 2004 年第 6 号）第八条、第三十六条，《流动资金贷款管理暂行办法》第九条、第三十九条等规定，被没收违法所得 33.6677 万元，罚款 2190 万元，合计 2223.6677 万元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对中信银行进行了投资。

3、其余八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   | 36,770.25  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 1,982.40   |
| 5  | 应收申购款   | 131,513.11 |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 170,265.76 |

## 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**

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

**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 12 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                               | -13.55%  | 1.40%       | -11.14%    | 1.40%         | -2.41% | 0.00% |
| 2019 年                               | 36.44%   | 1.17%       | 33.36%     | 1.15%         | 3.08%  | 0.02% |
| 2018 年 7 月 10 日<br>-2019 年 12 月 31 日 | 17.95%   | 1.26%       | 18.51%     | 1.24%         | -0.56% | 0.02% |

## 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股国际通指数增强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：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2018 年 7 月 10 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。

### 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费、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、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金相关账户的开户和维护费用；
- 10、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 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，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，自动在次月初 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、休息日或不可抗力等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 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，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，自动在次月初 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、休息日或不可抗力等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 0.005% 季费率计提。标的指数许可使用费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.005 \% \div \text{当季天数}$$

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。

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—10 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纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据 2020 年 7 月 2 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金基金经理变更公告》，在“第三部分、基金管理人”部分，更新了基金经理的相关信息，同时更新了基金管理人董事会成员、高级管理人员信息。

景顺长城基金管理有限公司

二〇二〇年七月四日