

## 建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金招募说明书 更新 摘要

2019年第1号

基金管理人:建信基金管理有限责任公司  
基金托管人:中国国际金融股份有限公司  
二〇一九年五月

## 【重要提示】

本基金经中国证券监督管理委员会2018年3月20日证监许可[2018] 503号文注册募集。本基金的基金合同于2018年4月19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、市场前景和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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,也不保证基金份额持有人的最低收益。

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,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、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,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理人风险,本基金的特定风险等。投资本基金可能遇到的风险包括:标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险,标的指数波动的风险以及基金份额净值与标的指数的跟踪偏离的风险。基金份额二级市场交易价格折溢价的风险,基金的退市风险,投资者申购、赎回失败的风险以及基金份额赎回对价的变现风险等等。

本基金属于股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于高风险/高收益的开放式基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金,主要采用完全复制策略,跟踪MSCI中国A股国际通指数(英文:MSCI China A Inclusion RMB Index)指数,其跟踪收益特征与标的指数的跟踪所表现的市场组合的风险收益特征相似。

投资者申购的基金份额自可卖出,当日未卖出的基金份额在份额交割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日卖出成功后T+2日可卖出和赎回。因此投资人办理申购业务的申购费可随赎回时机构若发生交收的,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。

投资者投资本基金时需具有上海证券交易所以人民币普通股票账户(即A股账户)或上海证券交易所以人民币普通股票账户。其中,上海证券交易所以人民币普通股票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MSCI中国A股国际通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以人民币普通股票账户;如投资人需要使用MSCI中国A股国际通指数的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上市人民币普通股票账户。

投资者在投资前,投资人应在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》等信息披露文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否适合自己,并自行承担投资风险。

基金的投资业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金业绩不构成基金业绩表现的保证。基金管理人遵循投资本基金投资的“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,由投资者自行承担。

本招募说明书所载内容截止日为2019年4月18日,有关财务数据和净值表现截止日为2019年3月31日(财务数据未经审计)。本招募说明书已经基金托管人复核。

## 一、基金管理人

名称:建信基金管理有限责任公司  
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层  
办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层  
设立日期:2006年6月19日  
法定代表人:孙志晨  
联系人:郭奕帆  
电话:010-66228888  
网址:www.jbxm.com.cn

建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2006]158号文批准设立。公司的股权结构如下:中国建设银行股份有限公司,66%;美国君安金融服务有限公司,25%;中国华电集团资本控股有限公司,10%。

本基金管理人的治理结构完善,经营运作规范,能够切实维护基金投资者的利益。股东分为公司权力机构,由全体股东组成,决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确规定了股东通过股东大会依法行使权利,不得以任何形式直接或间接干预公司的经营管理和本基金的投资运作。

董事会为公司的决策机构,对股东会负责,并向股东会汇报。公司董事会由9名董事组成,其中3名为独立董事。根据公司章程的规定,董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权,对公司基本制度的制定权和对外签署重要协议、聘任和解聘高级管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会,由6名监事组成,其中包括3名职工代表监事。监事会向股东会负责,主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员履行职责。

## (二) 主要人员情况

1. 董事成员  
孙志晨先生,董事长,1996年毕业于东北财经大学经济学学士学位,2006年获得长江商学院EMBA,历任中国建设银行总行筹资部证券处副处长,中国建设银行总行筹资部、零售业务部负责人,中国建设银行总行个人银行业务部副总经理。2005年9月出任建信基金公司总裁,2018年4月起任建信基金公司董事长。

张军红先生,董事,现任建信基金公司总裁。毕业于国防大学行政学院行政管理专业,获博士学位。历任中国建设银行筹资部稽核业务处科员、副主任科员、主任科员,零售业务部主任科员;个人银行业务部个人存款处副经理、高级副经理;行长办公室秘书一处高级助理兼秘书、秘书、高级经理;投资托管服务部总经理助理、副经理,投资托管服务部副经理;资产管理服务部副经理。2017年3月出任公司监事会主席,2018年4月起任建信基金公司总裁。

曹伟先生,董事,现任信安亚洲区总裁。1990年毕业于北京师范大学经济学院,获经济学学士学位,2012年获得华盛顿大学凯兹大学EMBA工商管理硕士学位。历任新加坡公共事业局公共关系处、新加坡国际有限公司业务发展总监,信诚基金管理(中国)资产管理(香港)有限公司总经理,英国保诚集团(UK)资产管理公司首席执行官,友利金融全球副总监,友利资产管理(台湾)首席执行官和执行董事,信安北亚地区副总监、总裁。

郑朔明先生,董事,现任信安国际(亚洲)有限公司北亚地区首席运营官。1989年毕业于新加坡国立大学。历任新加坡普华永道高级审计经理,新加坡沃兴资产管理董事总经理、营运总监、执行长,爱德蒙得洛希亚洲有限公司市场行销总监。

华源女士,董事,现任中国华电集团资本控股有限公司总经理助理。毕业于吉林大学,获经济学博士学位。历任《长春日报》新闻中心农村工作部记者,湖南卫视《听我非常说》财经栏目运营总监,舜程控股有限公司副总监、舜程精细化工有限公司总经理,吉林省信托有限责任公司业务七部副经理、理财中心总经理,财富管理中心副经理兼理财中心总经理、副总经理,光大证券财富管理中心总经理(MD)。

李全先生,独立董事,现任信安国际(亚洲)有限公司亚洲区首席运营官。1995年毕业于中国人民大学财政金融学院,1998年毕业于中国人民大学银行研究生学位,历任中国人民银行总行和中国农村信托投资公司职员,正大国际财务有限公司总经理助理/资金部总经理,博时基金管理有限公司副经理,新华资产管理股份有限公司总经理。

史亚萍女士,独立董事,现任嘉浩控股有限公司首席运营官。1994年毕业于对外经济贸易大学,获国际金融硕士学位;1996年毕业于耶鲁大学研究生院,获经济学硕士学位,先后在标准普尔国际评级公司、英国艾比国民银行、野村证券亚洲、雷普兄弟亚洲、中国投资有限公司、美国威灵顿资产管理公司、中金资本等多家金融机构担任管理职务。

邱峰先生,独立董事,现任天职国际会计师事务所(特殊普通合伙)首席合伙人。毕业于湖南大学高级工商管理专业,获EMBA学位,全国会计领军人才,中国注册会计师,注册资产评估师,高级会计师,澳洲注册会计师。1999年10月加入天职国际会计师事务所,现任首席合伙人。

## 2. 监事成员

马英芹女士,监事会主席,高级经济师,1984年毕业于中央财政金融学院,获学士学位,2009年获长江商学院高级管理人员工商管理硕士学位。1994年加入建设银行,历任总行资产负债管理部、零售业务部、个人银行部副处长、处长、资深客户经理(技术二级),个人金融副经理,个人存款与投融资部副经理。2018年6月起任建信基金公司监事会主席。

方静女士,董事,现任信安国际(亚洲)有限公司亚洲区首席运营官。曾任英国保诚集团市场发展区域总监及健康保险全球业务及健康保险副总监等职务。方女士1990年获新加坡国立大学法学学士学位,拥有新加坡、英格兰和威尔士以及香港地区律师从业资格。

李亦军女士,监事,高级会计师,现任中国华电集团资本控股有限责任公司机构与战略研究部总经理。1992年毕业于北京工业大学工业工程专业学士学位,2009年获中央财政大学会计专业硕士学位。历任北京北奥有限公司,中进会计师事务所,中恒华信会计师事务所,中国华电集团财务有限公司计划财务部副经理助理,副经理,中国华电集团资本控股(华电财务公司)计划财务部经理,中国华电集团财务有限公司财务部经理,中国华电集团资本控股有限公司企业融资部副经理。

安辉先生,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司信息技术总监。1996年毕业于北京工业大学计算机应用系,获学士学位。1996年8月加入中国建设银行,历任北京分行信息技术部干部,信息技术管理部北京开发中心项目经理、处长;2005年8月加入建信基金管理公司,历任信息技术部总经理助理、基金运营部副经理、信息技术部执行助理、信息技术部总经理,信息技术总监兼金融科技部总经理、信息技术总监。

严冰女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司人力资源部总经理。2005年7月毕业于中国人民大学行政管理专业,获硕士学位。曾任安永华明会计师事务所人力资源部人力资源部专员,2005年10月加入建信基金管理公司,历任人力资源部主管、主管、部门总经理助理、副总经理、总经理。

刘颖女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司审计部总经理。英国特许公认会计师公会(ACCA)资深会员。1997年毕业于中国人民大学会计系,获学士学位;2010年毕业于香港中文大学,获工商管理硕士学位。曾任毕马威华振会计师事务所高级审计师,华夏基金管理有限公司基金运营部高级经理,2006年12月加入建信基金管理有限责任公司,历任监察稽核部监察稽核专员、稽核主管、资深稽核员,内控合规部副经理,内控合规部副经理兼内控合规部审计部(二级部)总经理、审计部总经理。

## 3. 公司高管人员

张军红先生,总裁(简历请参见董事会成员)。  
曲冀军先生,副总裁,硕士。1999年7月加入中国建设银行总行,历任审计部科员、副主任科员、团委主任科员,总行总办办公室高级副经理,行长办公室高级副经理;2005年9月就职于建信基金管理公司,2015年董事会秘书兼合规管理部总监,投资管理部副总监,专户投资部总监和首席战略官;2013年8月至2015年7月,任我公司控股子公司建信资本管理有限公司董事、总经理。2015年8月6日至2019年3月13日任我公司副总监,2015年8月至2017年11月30日任建信资本管理有限公司董事、总经理,2017年11月30日至2018年11月1日至2017年11月30日任建信资本管理有限公司董事长。2019年3月从我公司离任。

张威威先生,副总裁,硕士。1997年7月加入中国建设银行辽宁省分行,从事个人零售业务,2001年1月加入中国建设银行总行个人金融部,从事证券投资基金销售业务,任高级副经理;2006年9月加入建信基金管理公司,一直从事基金销售管理工作,历任市场营销部副总监(主持工作)、总公司首都市场营销等职务。2015年8月6日起任我公司副总监。

吴刚明先生,副总裁,硕士。1992年7月至1996年8月在湖南省物资贸易总公司工作;1999年7月加入中国建设银行总行,先后在总行营业部、金融科技部、机构业务部从事信贷业务和证券业务,历任科员、副主任科员、主任科员、机构业务部高级副经理等职;2006年3月加入建信基金管理公司,担任董事兼秘书,并兼任综合管理部总经理。2015年8月6日起任我公司督察长,2016年12月23日起任我公司副总监。

吴奕玲女士,副总裁,硕士。1996年7月至1998年9月在福建省东海经贸股份有限公司工作;2001年7月加入中国建设银行总行人力资源部,历任副主任科员、业务经理、高级经理助理;2005年9月加入建信基金管理公司,历任人力资源部副经理助理、副总监、总监、人力资源部总经理兼综合管理部总经理。2016年12月23日起任我公司副总监。

马勇先生,副总裁,硕士。1993年8月至1995年8月在江苏省机械研究设计院工作。1996年7月加入中国建设银行总行,历任副主任科员、主任科员、秘书、高级经理级秘书,高端客户部总经理助理,财富管理部与私人银行部总经理助理,副总经理,建行黑龙江省分行副行长兼职务。2018年8月30日加入建信基金管理有限责任公司,2018年11月13日起任副总监;2018年11月1日起兼任我公司控股子公司建信资本管理有限公司董事长。

## 4. 督察长

吴刚明先生,督察长(简历请参见公司高级管理人员)。

## 5. 基金经理

梁洪涛先生,金融工程及指数投资部总经理,特许金融分析师(CFA),博士。2003年1月至2005年8月就职于大成基金管理有限公司,历任金融工程部研究员,规划发展部产品设计师,机构部高级经理。2005年8月加入建信基金管理有限责任公司,历任研究员研究员、高级研究员,2009年11月起任建信沪深300指数证券投资基金(LOP)的基金经理;2010年5月28日至2012年5月28日上午社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理;2012年3月16日起任建信深证100指数增强型证券投资基金的基金经理;2015年3月25日起任建信双利策略主题分级股票型证券投资基金的基金经理;2015年7月31日至2018年7月31日任建信中证互联网金融主题分级开放式证券投资基金的基金经理;2015年8月6日至2016年10月25日任建信中证有色金属指数分级开放式证券投资基金的基金经理;2018年2月6日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2018年2月7日起任建信鑫源回报及配置混合型证券投资基金的基金经理;2018年4月19日起任建信MSCI中

国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;2018年5月16日起任建信MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理;2018年6月1日起任建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。

6. 投资决策委员会成员  
张军红先生,总裁。  
陈尔峰先生,总裁助理。  
梁 秉先生,资产配置与量化投资部总经理。  
叶乐天先生,金融工程及指数投资部总经理助理。  
张 戈先生,资产配置及量化投资部总经理助理。  
7. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

(一) 基金托管人基本情况  
公司法定中文名称:中国国际金融股份有限公司(简称:中金公司)  
公司法定英文名称:China International Capital Corporation Limited(CICC)  
法定代表人:丁学东  
住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
邮政编码:100004

注册时间:1995年07月31日  
注册资本:人民币1,985,130,809元  
基金托管资格批文及文号:证监许可[2015]1441号  
联系人:张智

电 话:(86-10) 6505-1166  
中国国际金融股份有限公司(中金公司,39061HK)是由国内外著名金融机构和公司基于战略合作关系共同投资组建的中国第一家中外合资控股银行。

自1996年成立以来,中金公司一直致力于为客户提供高质量金融增值服务,建立了以研究为基础,投资银行、股票业务、固定收益、财富管理和投资管理全方位发展的业务结构。凭借深厚的经济、行业、法律法规等专业知识和优质的客户服务,中金公司在海内外媒体评选中屡获“中国最佳投行”“最佳销售服务团队”“最具影响力研究机构”等殊荣。

中金公司总部设在北京,在国内设有多家子公司,在上海和深圳设有分公司,在北京、上海、深圳等18个城市设有证券营业部。中金公司亦积极开拓海外市场,在香港、纽约、伦敦、新加坡四个国际金融中心设立了公司,不断拓展业务的辐射广度和海外业务,以保持资本跨境流动和财富全球配置的发展需求,令公司始终处于国际化发展的前列。

2015年,中金公司通过香港交易所主板成功挂牌上市,发行规模1.1亿美元,股票代码39061HK。秉承“植中国,通世界”的愿景,通过境内外业务的无缝对接,中金公司将持续为客户提供一流的金融服务,协助客户实现其投融资发展目标。

中金公司已取得多项业务牌照并开展业务,中金公司拥有证券业务牌照,业务领域覆盖境内、外市场,覆盖证券、证券投资基金、直接股权投资等多个领域,包括但不限于经纪业务、自营业务、基金的发起和资产管理、金融产品代理、托管业务、承销业务、投融资顾问、融资融券业务、场外衍生品等。2019年,中金公司连续两年被评为“最佳托管业务、承销业务、投融资顾问、融资融券业务、场外衍生品等”。最近三个年度内各项风险控制指标均符合监管标准。

中金公司资产管理(下文简称“托管”)于2014年5月正式成立,负责资管产品托管及运营外包业务。中金公司资产管理部为独立部门,与资管、自营、经纪、投行相互隔离,人员及岗位设置实现管理条线独立,有效的办公场所及独立的网络系统、机房、应用系统、多项备份措施,从而保证信息隔离和信息流畅,保障了托管业务的独立。

资产管理团队均具备金融、会计等相关专业学历背景,全部取得了基金从业资格、证券从业资格。清算、估值、注册登记、投资监督等主要业务岗位人员均来自托管银行、基金管理人、信托公司,平均从业年限在年以上,具备丰富的资管产品、基金运作管理经验。

(二) 基金托管部门及主要人员情况  
1. 李明瑞先生,执行董事,首席执行官,管理委员会主席。  
张先生自2016年5月起任中金公司的董事。自2016年3月起任中金公司首席执行官及管理委员会主席。张先生自1996年8月加入中金集团并参与中金公司的创办。于中金集团担任多个职位,包括自1996年9月至2006年3月担任中金集团副董事、管理委员会成员及代理主席,联席运营总监及投资银行部联席负责人。自2006年3月至2012年11月担任中金公司的高级副经理。自2012年11月至2015年6月担任利朴投资管理(中国)的管理合伙人。在1996年8月之前,自1984年1月至1985年12月担任花旗农业集团副处长,自1985年12月至1989年6月担任世界银行驻中国代表处业务专员,自1989年6月至1989年10月担任中国农村信托投资公司项目办主任以及自1988年10月至1994年1月担任世界银行的项目经济学家及顾问。担任过中金公司多个子公司的董事。

张先生于1982年12月自华东师范大学取得英语专业学历证书以及于1993年1月自美国乔治华盛顿大学取得工商管理硕士学位。  
2. 张蕾女士,资产管理部副经理。  
张蕾,资产管理部负责人,2002年10月加入中金公司运作部,先后负责过中金公司各类承销项目的簿记、清算、登记和托管工作,曾主要负责中金公司经纪业务清算、OTF业务清算、监管报表报送,自营业务清算支持等工作,同时辅助部门负责人对部门整体业务进行协调管理。在加入中金公司之前,曾任职于招商银行北京分行,担任信贷业务经理。

张蕾于1998年获得中央财经大学经济学专业学士学位,具备证券从业资格,基金从业资格,期货从业资格。  
(三) 基金托管业务经营情况  
自2015年6月30日获得证监会允许开展证券投资基金托管业务的批复(证监许可【2015】1441号),截至2018年12月31日,共托管产品405支,其中公募基金43支,资产管理规模16.70亿元,特定专户1只,托管规模56.58亿元;私募基金400支,均为经中国基金业协会备案的私募基金产品,资产管理规模154.75亿元。

中金公司托管业务自取得托管资格以来,严格按照《基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法规,履行法律法规和《基金合同》限定了托管人的基本权利和义务。中金公司托管部与交通银行、招商银行股份有限公司等托管银行合作,用于保管基金资产,账户由托管部资金清算岗负责管理。资金清算岗根据客户划款指令严格执行资金划拨。基金估值岗严格遵守《证券投资基金会计核算业务指引》、《信息披露办法》的相关规定,尽职尽责地履行估值核算、信息披露等各项义务,提升托管客户质量。中金公司托管部投资监督岗根据基金合同约定及相关法规,对基金的投资运作进行监督,客户场外交易指令全部通过投资监督岗审核并传递至相关岗位,实现了事前、事中、事后交易的监督及监督。

中金公司托管部于2014年6月采购恒生电子的托管业务系统,投资清算系统、投资清算系统、XDR系统,系统信息采用实时汇流提供的数据,托管系统采用同城灾备加磁带备份的方式,能够有效保障托管业务的数据安全。所有系统均已升级到恒生提供的最新系统。  
三、相关服务机构

## (一) 基金份额发售机构

1. 一级交易商  
(1) 招商证券有限责任公司  
注册地址:深圳福田区益田路江苏大厦38—45层  
客服电话:95565,4008881111  
网址:www.newone.com.cn  
(2) 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C座  
法定代表人:张佑君  
客服电话:95588  
网址:www.citics.com

(3) 中信证券(山东)有限责任公司  
注册地址:山东省青岛市市南区东海西路222号14楼2001  
法定代表人:姜国华  
客服电话:95548  
网址:www.zxwt.com.cn  
(4) 东北证券股份有限公司  
注册地址:吉林省长春市生态大街6666号  
法定代表人:李福春  
客服电话:95390  
网址:http://www.nesc.cn

(5) 渤海证券股份有限公司  
注册地址:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室  
法定代表人:王春峰  
客服电话:400-651-5888  
网址:www.bhzq.com  
(6) 中泰证券股份有限公司  
注册地址:山东省济南市市中区经七路86号  
法定代表人:李玮  
客服电话:95538  
网址:www.ztsc.com.cn

(7) 信达证券股份有限公司  
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼  
法定代表人:张志刚  
客服电话:95321  
网址:www.cindasc.com

(8) 中国建投证券股份有限公司  
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼  
法定代表人:王常青  
客服电话:400-8888-108  
网址:www.csc108.com

(9) 中国银河证券股份有限公司  
注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层  
法定代表人:陈共炎  
客服电话:4008-888-8888  
网址:www.chinastock.com.cn

(10) 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  
法定代表人:杨红菊  
客服电话:4008888666  
网址:www.gtja.com

(11) 光大证券股份有限公司  
注册地址:上海市静安区新闸路168号  
法定代表人:周健梅  
客服电话:95625  
网址:www.ebscn.com

(12) 长江证券股份有限公司  
地址:湖北省武汉市江汉区新华路特号  
法定代表人:李新华  
客服电话:95679  
网址:www.95679.com

(13) 申万宏源西部证券股份有限公司  
注册地址:新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室  
法定代表人:李海  
客服电话:4008-000-562  
网址:www.hysec.com

(14) 申万宏源证券有限公司  
办公地址:上海市徐汇区长乐路99号45层  
法定代表人:李梅  
客服电话:956323或4008895623  
网址:www.swhyc.com

(15) 海通证券股份有限公司  
地址:上海市广东路689号  
法定代表人:周杰  
客服电话:95653  
网址:www.htsec.com

(16) 安信证券股份有限公司  
注册地址:广东省深圳市福田区金田路4018号安联大厦36层、28层A02单元  
法定代表人:王连志  
客服电话:95617  
网址:www.aessence.com.cn

(17) 平安证券有限责任公司  
注册地址:广东省深圳市福田区金田路4306号荣超大厦16-20楼  
法定代表人:何之江  
客服电话:95611  
网址:www.stock.pingan.com

(18) 中国国际金融股份有限公司  
注册地址:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
法定代表人:丁学东  
电话:(86-10) 6505-1166  
网址:http://www.cicc.com/

(19) 方正证券股份有限公司  
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  
法定代表人:施华  
客服电话:95671  
网址:www.foundsec.com

(20) 中国中投证券有限责任公司  
住所:广东省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18-21层及第04层  
法定代表人:高涛  
客服电话:95532或4006008008  
网址:http://www.china-invs.cn/

(21) 东兴证券股份有限公司  
住所:北京市西城区金融大街5号新盛大厦12、15层  
基金托管资格批文及文号:证监许可[2015]1441号  
法定代表人:张涛  
客服电话:95309  
公司官网:http://www.dxzq.net/

(22) 东海证券股份有限公司  
住所:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层  
法定代表人:侯军  
客服电话:95531 或 400-8888-588  
公司官网:http://www.longone.com.cn/

(23) 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  
法定代表人:曹宏  
客服电话:0755-83228968  
网址:www.cc168.com.cn

(24) 东吴证券股份有限公司  
住所:江苏省苏州工业园区星阳街5号  
法定代表人:范力  
客服电话:95330  
网址:http://www.dwzq.com.cn/

2. 二级市场交易类证券商  
包括具有经纪业务资格及深圳证券交易所会员资格的所有证券公司。  
3. 基金管理人可以根据相关法律法规要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二) 登记机构  
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  
电话:010-59378866  
传真:010-59378907  
(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:俞卫华  
电话:021-31258666  
传真:021-31258600  
联系人:陆奇  
经办律师:吕晓、陆奇

(四) 审计会计师事务所  
普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号展翼大厦607单元01室  
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号领企业广场2座11楼  
电话:021-2323 8888  
执行事务合伙人:李丹  
经办注册会计师:许康理、沈兆杰  
联系人:沈兆杰

## 四、基金的名称

建信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

## 股票型证券投资基金

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。  
七、基金的投资方向  
本基金投资于标的指数的成份股和备选成份股。  
为更好地实现本基金的投资目标,本基金可少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小创、创业板及其他经中国证监会核准上市股票)、债券、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、权证、股指期货以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的90%;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行。  
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

## 八、基金的投资策略

(一) 完全复制策略  
本基金为完全被动式指数基金,采用完全复制,即按照成份股在标的指数中的基准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。但因特殊情况(如流动性不足等)导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具进行替代,或者对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使投资组合紧密跟踪标的指数的表现。

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%,年跟踪误差率不超过2%。如标的指数的编制规则调整或其跟踪原因,导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围,基金管理人应采取合理措施,避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。

(二) 衍生品金融产品投资策略  
本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生品金融产品,如权证以及其他与标的指数的成份股或备选成份股相关的衍生工具。  
股指期货投资股指期货将力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位调整的交易成本,同时跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。通过对股指期货和股指期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型,采用估值合理、流动性好、交易活跃的对冲合约,对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化,提高投资组合的运作效率。本基金将通过对冲权证证券的基本面研究,结合多种定价模型,根据基金资产组合情况适时进行权证的交易。

(三) 债券投资策略  
本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的,综合考虑流动性和收益性,构建本基金债券投资组合。  
(四) 资产支持证券投资策略  
本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将通过资产支持证券基础资产及结构特征的研究,结合多种定价模型,严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

## 九、基金的投资比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金的业绩比较基准为MSCI中国A股国际通指数(英文:MSCI China A Inclusion RMB Index)。  
如指数发布机构变更或停止上述指数的编制及发布,或者上述标的指数由其他指数代替,或由指数编制方法等发生重大变更导致上述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基金份额持有人合法权益的原则,通过适当的程序变更本基金的业绩比较基准,并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。若标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等),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业绩比较基准,报中国证监会备案并及时公告。

## 十、基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于高风险/高收益的开放式基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金,主要采用完全复制策略,跟踪MSCI中国A股国际通指数,其风险收益特征与标的指数的跟踪所表现的市场组合的风险收益特征相似。

## 十一、基金的投资组合报告

基金管理人及基金托管人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。  
基金托管人中国国际金融股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本投资组合报告所载数据截至2019年3月31日,本报告中的财务资料未经审计。

## 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	962,289,194.76	97.89
	其中:股票	962,289,194.76	97.89
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	21,498,176.72	2.08
	其中:货币资产	261,186.66	0.04
8	其他资产	1,014,389,547.18	100.00

## 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(
----	------	-------