新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

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
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:上海证券交易所
上市时间:2018 年 12 月 7 日
公告时间:2018 年 12 月 4 日

一、重要声明与提示

新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 (以下简称“本基金”)上市交易公告书(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称 “《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,新华基金管理股份有限公司(以下简称“本基金管理人”)的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。本基金托管人中国农业银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

本公告第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本公告未涉及的有关内容, 请投资者详细查阅 2018 年 9 月 21 日登载在《证券时报》及本公司网站(www.ncfund.com.cn)上的《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》。

二、基金概览

1、基金名称:新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金
2、基金二级市场交易简称:MSCI 新华
3、二级市场交易代码:512920
4、基金申购、赎回简称:MSCI 新华
5、申购、赎回代码:512921
6、截至公告日前两个工作日即 2018 年 11 月 30 日基金份额总额:280,092,640.00 份
7、截至公告日前两个工作日即 2018 年 11 月 30 日基金份额净值:280,372,828.89 元
8、本次上市交易份额:280,092,640.00 份
9、上市交易的证券交易所:上海证券交易所
10、上市交易日期:2018 年 12 月 7 日
11、基金管理人:新华基金管理股份有限公司
12、基金托管人:中国农业银行股份有限公司
13、上市推荐人:中信建投证券股份有限公司
14、申购赎回代理券商(以下简称“一级交易商”):中国中投证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中银国际证券股份有限公司。

若有新增本基金的申购、赎回代办券商,基金管理人将另行公告。

三、基金的募集与上市交易

(一)本次基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会证监许可【2018】1019 号。
2、基金运作方式:交易型开放式
3、基金合同期限:不定期
4、发售日期:本基金募集期自 2018 年 9 月 26 日至 2018 年 10 月 31 日,通过网上现金认购和网下现金认购两种方式公开发售。其中,网上现金认购的发售日期为 2018 年 10 月 29 日至 2018 年 10 月 31 日;网下现金认购的发售日期为 2018 年 9 月 26 日至 2018 年 10 月 31 日。
5、发售价格:1.00 元人民币
6、发售期限:网下现金认购 21 个工作日,网上现金认购 3 个工作日。
7、发售方式:网上现金认购和网下现金认购两种方式。
8、发售机构
(1)网下现金发售直销机构:新华基金管理股份有限公司
(2)网下现金发售代理机构:中国中投证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信建投证券股份有限公司。
(3) 网上现金销售机构包括具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司。

(二)基金合同生效

本基金根据中国证监会证监许可[2018]1019 号文批准,自 2018 年 9 月 26 日起公开募集,截止 2018 年 10 月 31 日,基金募集工作已顺利结束。经瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)验资,本次发行募集金额为 280,092,640.00 元, 其中净认购金额为人民币 280,092,000.00 元, 折合基金份额 280,092,000.00 份;通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期产生的利息 640.00 元,将折算为基金份额归投资者所有;通过网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后产生的利息共计 72,620.06 元,计入基金财产,不折算为投资者基金份额。募集资金已于 2018 年 11 月 6 日划入本基金在基金托管人中国农业银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为 2,175 户。按照每份基金份额发售面值 1.00 元人民币计算,募集期募集的基金份额共计 280,092,640.00 份,已全部计入投资者账户,归投资者所有。其中本基金管理人新华基金管理股份有限公司基金从业人员认购本基金份额总量为 0,本公司高级管理人员、基金投资、研究部门负责人和基金经理认购本基金份额总量的数量区间为 0。本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《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》、《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》的有关规定,本基金募集符合有关条件,本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续,并于 2018 年 11 月 7 日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人开始正式管理本基金。

(三)基金份额折算

本基金不进行基金份额折算。

(四)基金上市交易

1、本基金上市交易的核准机构和核准文号:上证自律监管决定书【2018】150 号
2、上市交易日期:2018 年 12 月 7 日。
3、上市交易的证券交易所:上海证券交易所。

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。

4、基金二级市场交易简称:MSCI 新华。
5、基金二级市场交易代码:512920。
6、基金申购、赎回简称:MSCI 新华。
7、基金申购、赎回代码:512921。

本基金管理人自 2018 年 12 月 7 日开始办理本基金的申购、赎回业务。投资者应当在本基金指定的一级交易商(申购赎回代理券商)办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

目前本基金的一级交易商包括:

中国中投证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中银国际证券股份有限公司。

上述排名不分先后。若有新增本基金的申购赎回代办券商,本公司将另行公告。

8、本次上市交易份额:280,092,640.00 份
9、未上市交易份额的流通规定:本基金上市交易后,所有的基金份额均可进行交易,不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

(一)基金份额持有情况

截至 2018 年 11 月 30 日,基金份额持有人户数为 2,175 户,平均每户持有的基金份额为 128,778.23 份。

(二)持有人结构

截至 2018 年 11 月 30 日,本基金持有人结构如下:机构投资者持有的基金份额为 80,082,640.00 份,占基金总份额的 28.59%;个人投资者持有的基金份额为 200,010,000.00 份,占基金总份额的 71.41%。

(三)前十名基金份额持有人的情况

截至 2018 年 11 月 30 日,前十名基金份额持有人情况:

序号	基金份额持有人名称	持有基金份额(份)	占基金总份额的比例(%)
1	北京恒昌弘德资产管理有限公司-恒德利得 1 号私募证券投资基金	20,000,000.00	7.14%
2	上海呈瑞投资管理有限公司-念空瑞丹 1 号私募证券投资基金	15,000,000.00	5.36%
3	上海呈瑞投资管理有限公司-呈瑞平心 1 号私募基金	15,000,000.00	5.36%
4	中银国际证券股份有限公司	8,000,000.00	2.86%
5	东兴证券股份有限公司	7,999,640.00	2.86%
6	宋媛媛	7,000,000.00	2.50%
7	招商证券股份有限公司	7,000,000.00	2.50%
8	华泰证券股份有限公司	5,000,000.00	1.79%
9	薛慧娟	3,000,000.00	1.07%
10	欧志球	3,000,000.00	1.07%

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1、公司概况
名称:新华基金管理股份有限公司
住所:重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号办公楼第 19 层
办公地址:北京市海淀区西三环北路 11 号海通时代商务中心 C1 座
重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号办公楼第 19 层
法定代表人:陈重
设立日期:2004 年 12 月 9 日
批准设立机关:中国证监会
批准设立文号:中国证监会证监基金字【2004】197 号
注册资本:贰亿壹仟柒佰伍拾万元人民币
股权结构:

股东名称	出资额(万元)	占注册资本金比例
恒泰证券股份有限公司	12,750	58.62%
新华信托股份有限公司	7,680	35.31%
杭州永原网络科技有限公司	1,320	6.07%
合计	21,750	100%

2、内部组织结构及职能

公司按照建立和完善公司治理结构的要求,设立董事会和监事会。

公司实行董事会领导下的总经理负责制。总经理全面负责公司的经营管理。

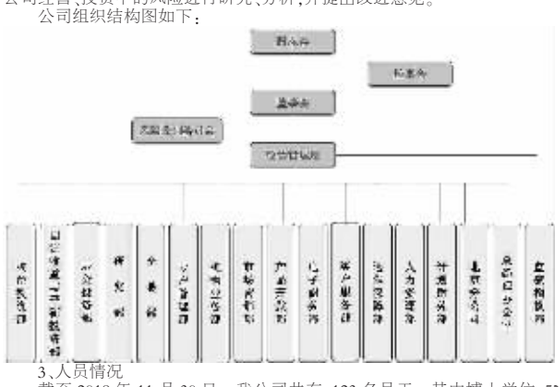
公司设立了投资管理委员会、专户投资管理委员会和风险管理委员会等专业委员会。

投资管理委员会是公司旗下证券投资基金资产运作的决策机构, 总经理担任主任委员,其他委员由总经理指定人员担任。根据《基金法》、《基金合同》、《证券投资基金运作管理办法》等的规定,审议、决定基金经理提出的投资策略和投资方案,定期对基金经理的业绩进行评价;审核并决定基金产品方案;对基金资产运作所涉及的重大投资进行决策。

专户投资管理委员会是公司特定客户资产管理业务资产运作的决策机构,由总经理办公会研究决定其主任委员及其他成员。根据《基金法》、《资产管理合同》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等的规定,审议、决定专户投资经理提出的投资策略和投资方案,定期对专户投资经理的业绩进行评价,对专户管理所涉及的重大投资进行决策。

风险管理委员会负责确保公司内部控制制度的有效执行及投资风险的严格控制,定期或不定期对公司内部风险控制制度的有效执行进行评估,对公司经营、投资中的风险进行研究、分析,并提出改进意见。

公司组织结构图如下:



3、人员情况

截至 2018 年 11 月 30 日, 我公司共有 123 名员工, 其中博士学位 5?人、硕士学位 48??人和学士学位 52 人。

4、信息披露负责人:齐岩
咨询电话:010-68726666
5、基金管理业务情况

截至 2018 年 11 月,新华基金管理股份有限公司目前旗下共管理 46 只公募产品及多只专户产品, 旗下管理的基金包括新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、 新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华惠鑫债券型证券投资基金 (LOF)、 新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华精选低波动股票型证券投资基金、新华中证环保产业指数分级证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、 新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华增强债券型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华丰盈回报债券型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金、新华华瑞灵活配置混合型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华高端制造灵活配置混合型证券投资基金、 新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金、新华华丰灵活配置混合型证券投资基金、新华安享惠钰定期开放债券型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金以及新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金。

6、本基金基金经理简介

邓岳先生:信息与信号处理专业硕士,9 年证券从业经验,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。2017 年 6 月加入新华基金管理股份有限公司,2017 年 8 月 7 日起任新华中证环保产业指数分级证券投资基金基金经理。

(二)基金托管人

1、公司概况
名称:中国农业银行股份有限公司
住所:北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座
法定代表人:周慕冰
成立时间:2009 年 1 月 15 日
组织形式:股份有限公司
注册资本:32,479,411.7 万元人民币
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]23 号
联系人:贺倩
联系电话:010-66060069
2、主要人员情况

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

3、基金托管业务经营情况

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

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

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

(三)一级交易商

目前,本基金一级交易商名单如下:

1)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 18-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元
法定代表人:高涛
联系人:万玉琳
客服电话:95532
网址:www.china-invs.cn
2)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
法定代表人:陈共炎
联系人:邓颜
客服电话:400-888-8888
网址:www.chinastock.com.cn
3)长江证券股份有限公司
住所:湖北省武汉市新华路特 8 号
法定代表人: 尤习贵
联系人:李良
客服电话:95579 或 4008-888-999
网址:www.95579.com
4)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号
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
客服电话: 95521
网址:www.gtja.com
5)平安证券股份有限公司
住所:深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层
法定代表人:何之江
联系人:石静武
客服电话:95511-8
网址:www.pingan.com
6)华泰证券股份有限公司
住所:南京市江东中路 228 号
法定代表人:周易
联系人:庞晓芸
客服电话:95597
网址:www.htsc.com.cn
7)恒泰证券股份有限公司
住所:内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座
法定代表人:庞介民
联系人:熊丽
客服电话:400-196-6188
网址:www.cnht.com.cn
8)中信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
办公地址:北京市朝阳门内大街 188 号
法定代表人:王常青
联系人:权唐
客服电话:95587
网站:www.csc108.com
9)中国国际金融股份有限公司
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
法定代表人:毕明建
电话:010-65051166
联系人:吴思渊
网址:http://www.cicc.com
10)招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层
法定代表人:霍达
联系人:林生迎
客服电话: 95565
网站: www.newone.com.cn
11)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
办公地址:北京朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦
法定代表人:张佑君
联系人:侯艳红
客服电话:95548
网址:www.cs.ecitic.com
12)中信证券(山东)有限责任公司
住所:青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001
法定代表人:姜晓林
客服电话:95548
联系人:吴忠超
公司网址:www.citicssd.com
13)中银国际证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层
法定代表人:宁敏
联系人:李云龙
客服电话:021-20328000
网址:www.bocichina.com
(四)基金验资机构
名称:瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市海淀区西四环中路 16 号院 2 号楼 4 层
办公地址: 北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 5-11 层
法定代表人:杨剑涛
电话:010-88219191
传真:010—88210558
经办注册会计师:张伟、胡慰
联系人:胡慰

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件:基金合同摘要。

七、基金财务状况

(一)本基金募集期间相关费用明细

本基金募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担,不从基金财产列支。

(二)本基金发售后至本公告书公告前的重要财务事项

本基金认购后至本公告书公告前无重要财务事项发生。

(三)基金资产负债表

本基金 2018 年 11 月 30 日资产负债表(未经审计)如下:

资产	期末	期初	负债和所有者权益	期末	期初
	余额	余额		余额	余额
资 产:			负债:		
银行存款	280,090,795.00		短期借款		
结算备付金			交易性金融负债		
存出保证金			衍生金融负债		
交易性金融资产	35,897.00		卖出回购金融资产款		
其中:股票投资	35,897.00		应付证券清算款	35,744.16	
基金投资			应付赎回款		
债券投资			应付管理人报酬	88,302.41	
资产支持证券投资			应付托管费	17,660.48	
衍生金融资产			应付销售服务费		
买入返售金融资产			应付交易费用	32.38	
应收证券清算款			应付税费		
应收利息	348,360.68		应付利息		
应收股利			应付利润		
应收申购款			其他负债	33,744.42	
其他资产	73,260.06		负债合计	175,483.85	
			所有者权益:		
			实收基金	280,092,640.00	
			未分配利润	280,188.89	
			所有者权益合计	280,372,828.89	
资产合计:	280,548,312.74		负债与持有人权益总计:	280,548,312.74	

八、基金投资组合

截至 2018 年 11 月 30 日本基金的基金投资组合情况如下:

(一)截至 2018 年 11 月 30 日基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	35,897.00	0.01
	其中:股票	35,897.00	0.01
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券		
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	280,090,795.00	99.84
6	其他资产	421,620.74	0.15
7	合计	280,548,312.74	100.00

(二)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		
B	采矿业		
C	制造业		
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		
E	建筑业		
F	批发和零售业		
G	交通运输、仓储和邮政业		
H	住宿和餐饮业		
I	信息传输、软件和信息技术服务业		
J	金融业	33,353.00	0.01
K	房地产业	2,544.00	0.00
L	租赁和商务服务业		
M	科学研究和技术服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育		
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业		
S	综合		
	合计	35,897.00	0.01

(三)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	600036	招商银行	300	8,565.00	0.0031
2	601318	中国平安	100	6,349.00	0.0023
3	601166	兴业银行	300	4,782.00	0.0017
4	600000	浦发银行	400	4,284.00	0.0015
5	601398	工商银行	700	3,731.00	0.0013
6	601288	农业银行	1,000	3,570.00	0.0013
7	000002	万科 A	100	2,544.00	0.0009
8	000001	平安银行	200	2,072.00	0.0007
9					
10					

(四)按债券品种分类的债券投资组合

截至 2018 年 11 月 30 日,本基金未持有债券。

(五)按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

截至 2018 年 11 月 30 日,本基金未持有债券。

(六)按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

截至 2018 年 11 月 30 日,本基金未持有资产支持证券。

(七)报按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

截至 2018 年 11 月 30 日,本基金未持有权证。

(八)本基金投资的股指期货交易情况说明

截至 2018 年 11 月 30 日,本基金无股指期货投资。

(九)本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金合同尚无国债期货投资政策。

(十)投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

2、本基金投资的前十名证券没有超出基金合同约定。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	348,360.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	73,260.06
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	421,620.74

4、持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2018 年 11 月 30 日,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至 2018 年 11 月 30 日,前十名股票中不存在流通受限情况。

九、重大事件揭示

本基金自基金合同生效至上市交易期限未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、《基金合同》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产。

(二)根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定,对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。。

基金托管人发现基金管理人的行为违反 《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正, 基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人将报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、上市推荐人意见

本基金上市推荐人为中信建投证券股份有限公司。上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见:

1、本基金上市符合 《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件;

2、基金上市文件真实、准确、完整,符合相关规定要求,文件内所载的资料均经过核实。

十三、备查文件目录

(一)中国证监会准予本基金注册的文件;

(二)《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》;

(三)《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》;

(四)《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》;

(五)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;

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(七)基金托管人业务资格批件、营业执照;

(八)中国证监会要求的其他文件。

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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

新华基金管理有限公司
二〇一八年十二月四日

附件:基金合同摘要

一、基金合同当事人及权利义务

(一) 基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:

(1)依法募集资金;

(2)自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;

(3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;

(4)销售基金份额;

(5)按照规定召集基金份额持有人大会;

(6)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资人的利益;

(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

(8)选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用;

(10)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;

(11)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;

(12)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

(13)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券、转融通;

(14)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

(15)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构;

(16)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回和非交易过户等业务规则;

(17)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:

(1)依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

(2)办理基金备案手续;

(3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立, 对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(7)依法接受基金托管人的监督;

(8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购、赎回对价的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回对价,编制申购赎回清单;

(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10)编制季度、半年度和年度基金报告;

(11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

(13)按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回对价;

(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上;

(17) 确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资人能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

(20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

(23)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人;

(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26)建立并保存基金份额持有人名册;

(27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:

(1)自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;

(2)依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作, 如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资人的利益;

(4)根据相关市场规则,为基金开设或注销资金账户、证券账户等投资所需账户,为基金办理证券交易等资金清算;

(5)提议召开或召集基金份额持有人大会;

(6)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;

(7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于:

(1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;

(2)设立专门的基金托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;

(3)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,确保基金财产的安全, 保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立; 对所托管的不同的基金分别设置账户, 独立核算,分账管理,保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立;

(4)