

上投摩根基金管理有限公司关于上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金关联交易的公告

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信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《关于同意完全按照指数构成比例投资的基金品种按照〈基金法〉规定从事关联交易的复函》的有关规定，在基金管理人履行相关程序后，允许完全按照有关指数构成比例进行证券投资的基金品种买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券。

上投摩根基金管理有限公司（以下简称“本公司”）管理的“上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金”主要投资于目标 ETF、标的指数成份股及备选成份股。基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标 ETF。因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。其中，MSCI 中国 A 股人民币指数的成份股中的浦发银行（600000.SH）及中国平安(601318.SH)的发行人分别是本公司及上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金托管人的关联方，浦发银行（600000.SH）是本公司的关联方上海浦东发展银行股份有限公司发行的证券，中国平安(601318.SH)是上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金托管人平安银行股份有限公司的关联方中国平安保险(集团)股份有限公司发行的证券。

为最大限度地降低上述基金投资的跟踪误差，保护基金份额持有人的合法权益，本基金管理人已按规定履行相关程序，现将浦发银行（600000.SH）和中国平安(601318.SH)纳入上投摩根 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资标的，并将严格按照法律、法规和基金合同的规定进行日常投资管理。相关投资情况将按规定在基金的定期报告中进行披露。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。投资者投资于各基金前应认真阅读相应基金的基金合同、招募说明书。

上投摩根基金管理有限公司

2020 年 7 月 29 日