

上投摩根MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金 基金产品资料概要更新

编制日期：2021年4月8日

送出日期：2021年4月9日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

| | | | |
|---------|---|----------------|--------------------|
| 基金简称 | 上投摩根 MSCI 中国 A 股 ETF | 基金代码 | 515770 |
| 基金管理人 | 上投摩根基金管理有限公司 | 基金托管人 | 平安银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2020-05-13 | 上市交易所及上市日期 | 上海证券交易所 2020年6月19日 |
| 基金类型 | 股票型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 交易型开放式 | 开放频率 | 每个开放日 |
| 基金经理 | 胡迪 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021-01-07 |
| | | 证券从业日期 | 2008-02-01 |
| | 何智豪 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021-02-19 |
| | | 证券从业日期 | 2014-07-11 |
| 其他 | 1. 本基金二级市场交易简称为MSCIAETF、二级市场交易代码为515770。 2. 本基金为股票型指数证券投资基金。 | | |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

投资者欲了解详细情况，请阅读招募说明书第十章“基金的投资”。

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资范围 | 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、衍生工具（股指期货、股票期权等）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单以及法律法规或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相关规定）。 本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。 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。 |

基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产80%。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金做相应调整。

三、投资策略

本基金采用完全复制法，按照标的指数成份股构成及其权重构建股票资产组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化对股票组合进行动态调整。但因特殊情况导致基金无法有效跟踪标的指数时，本基金将运用其他方法建立实际组合，力求实现基金相对业绩比较基准的跟踪误差最小化。

1、资产配置策略

为了实现跟踪误差最小化，本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产80%。

2、股票投资策略

（1）投资组合构建

本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建股票资产组合，对于因法规限制、流动性限制而无法交易的成份股，将采用与被限制股预期收益率相近的股票或股票组合进行相应的替代。在投资运作过程中，本基金根据成份股构成及其权重的变动进行动态调整。

（2）投资组合调整

1) 定期调整

本基金所构建的投资组合将定期根据所跟踪标的指数成份股的调整进行相应的跟踪调整。指数调整方案公布后，本基金将及时对现有组合的构成进行相应的调整，若成分股的集中调整短期内会对跟踪误差产生较大影响，将采用逐步调整的方式。

2) 不定期调整

①根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据标的指数权重比例的变化，进行相应调整。

②当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置，基金管理人将综合考虑跟踪误差和投资者利益，选择相关股票进行适当的替代。

③本基金将根据申购和赎回情况对股票投资组合进行调整，保证基金正常运行，从而有效跟踪标的指数。

本基金力争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等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，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。

3、金融衍生品投资策略

本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。

4、债券投资策略

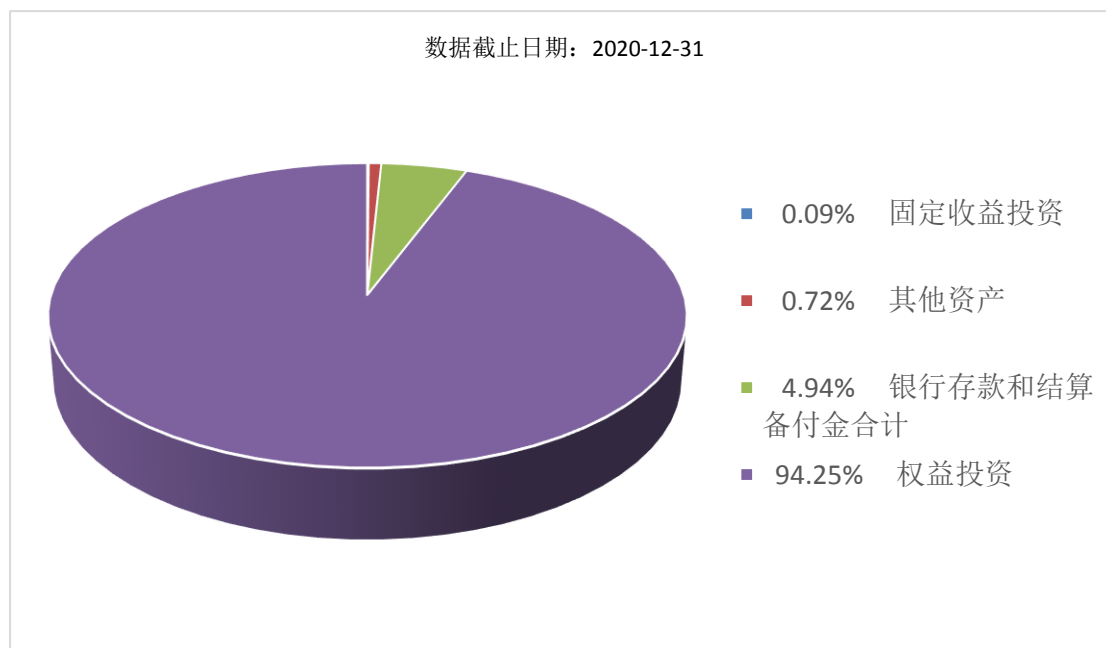
本基金进行债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。

5、资产支持证券投资策略

本基金综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量等因素，

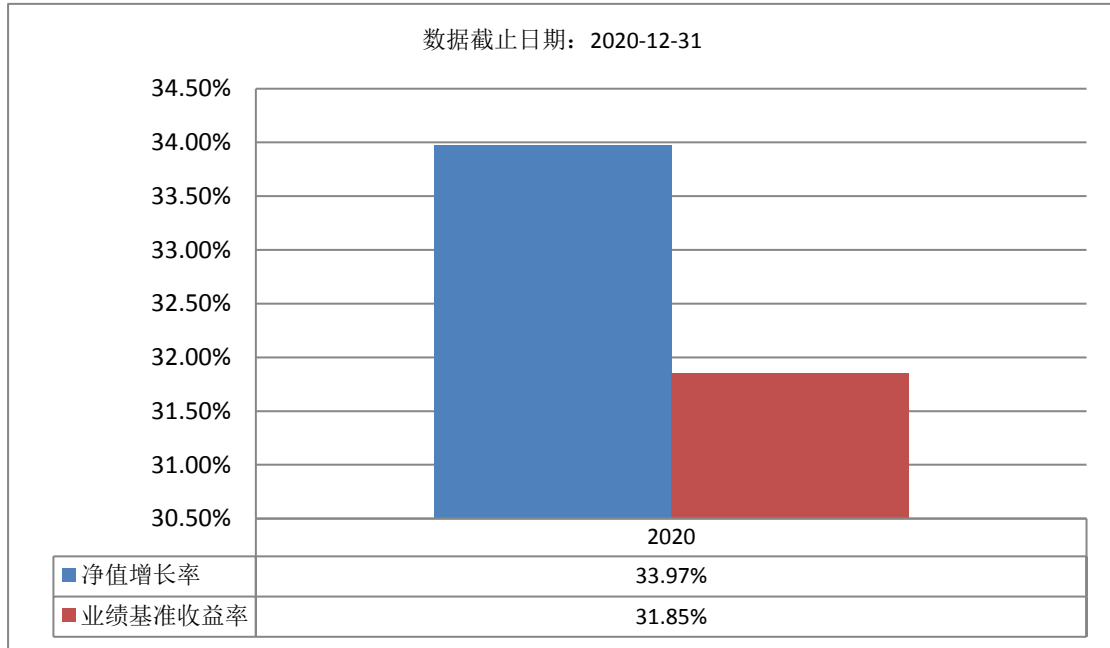
| | |
|--------|--|
| | <p>主要从资产池信用状况、违约相关性、历史违约记录和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估,在严格控制风险的情况下,确定资产合理配置比例,在保证资产安全性的前提条件下,以期获得长期稳定收益。</p> <p>6、融资及转融通证券出借策略</p> <p>本基金参与融资业务,将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件,选择合适的交易对手方。</p> <p>7、存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的深入研究判断,进行存托凭证的投资。</p> <p>未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,基金管理人在履行适当程序后,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。</p> |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为标的指数,即MSCI中国A股人民币指数收益率。本基金标的指数变更的,相应更换基金名称和业绩比较基准,并在履行适当程序后及时公告。 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型指数基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,具有与标的指数相似的风险收益特征。 |

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表
投资组合资产配置图表



注: 本基金合同生效日为2020年5月13日,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：本基金合同生效日为2020年5月13日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

1. 投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理机构可按照不超过0.5%的标准收取佣金；
2. 场内交易费用以证券公司实际收取为准。

（二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别 | 收费方式/年费率 |
|---------|---------------------------------|
| 管理费 | 0.15% |
| 托管费 | 0.05% |
| 指数许可使用费 | 0.05% |
| 其他费用 | 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费用。 |

- 注：1. 本基金交易证券等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。
 2. 指数许可使用费的收取下限为每季度5000美元或等值人民币，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者欲购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

1、投资于本基金的主要风险包括：

- （1）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险
- （2）标的指数波动的风险
- （3）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险
- （4）跟踪误差控制未达约定目标的风险
- （5）标的指数变更的风险

- (6) 指数编制机构停止服务的风险
- (7) 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险
- (8) 参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险
- (9) 成份股停牌的风险
- (10) 成份股退市的风险
- (11) 退市风险
- (12) 投资者申购失败的风险
- (13) 投资者赎回失败的风险
- (14) 退补现金替代方式的风险
- (15) 基金份额赎回对价的变现风险
- (16) 第三方机构服务的风险
- (17) 资产支持证券的投资风险
- (18) 股指期货的投资风险
- (19) 股票期权的投资风险
- (20) 参与融资及转融通证券出借业务的风险
- (21) 流动性风险
- (22) 存托凭证的投资风险

2、其他风险

- (1) 管理风险与操作风险
- (2) 技术风险
- (3) 不可抗力

3、声明

(1) 本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。基金投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

(2) 除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过基金代销机构代理销售，但是，基金资产并不是代销机构的存款或负债，也没有经基金代销机构担保收益，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

关于本基金完整的风险揭示请见本基金的《招募说明书》的“风险揭示”章节。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作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、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站

网址：www.cifm.com 客服电话：400-889-4888

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料