

摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)

基金产品资料概要(更新)

编制日期: 2021年12月23日

送出日期: 2021年12月24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 | 大摩资源优选混合(LOF) | 基金代码 | 163302 |
| 基金管理人 | 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国光大银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2005-09-27 | 上市交易所及上市日期 | 深圳证 券交易 所 2007-07-05 |
| 基金类型 | 混合型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 普通开放式 | 开放频率 | 每个开放日 |
| 基金经理 | 徐达 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2016-06-17 |
| | | 证券从业日期 | 2012-07-06 |
| 其他 | 1、场内简称:大摩资源LOF;交易代码:163302 2、基金合同生效后,基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的,基金管理人应当及时报告中国证监会;连续20个工作日出现前述情形的,基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。 | | |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

详见《招募说明书》第十二部分“基金的投资”

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | <p>将中国资源的经济价值转换为持续的投资收益,为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报。</p> <p>本基金将把握资源的价值变化规律,对各类资源的现状和发展进行分析判断,及时适当调整各类资源行业的配置比例,重点投资于各类资源行业中的优势企业,分享资源长期价值提升所带来的投资收益。</p> |
| 投资范围 | <p>在国内证券市场依法发行上市的A股、债券及经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具,其中投资于资源类上市公司股票的比例不低于基金股票资产的80%。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金将中长期持有以资源类股票为主的股票投资组合,并注重资产在资源类各相关行业的配置,适当进行时机选择。采用“自上而下”为主、结合“自下而上”的投资方法,将资产管理策略体现在资产配置、行业配置、股票及债券选择的过程中。</p> <p>(1) 股票投资策略</p> <p>A、根据资源的经济价值,注重对资源类上市公司所拥有的资源价值评估和公司证券价值的估值分析;对于精选个股将坚持中长期持有为主的策略。</p> <p>B、我国证券市场处于新兴加转轨的阶段,市场的波动性较强,所以本基金将依据市</p> |

场判断和政策分析,同时根据类别行业的周期性特点,采取适当的时机选择策略,以优化组合表现。

(2) 债券投资策略

本基金采取“自上而下”为主,“自下而上”为辅的投资策略,以长期利率趋势分析为基础,兼顾中短期经济周期、政策方向等因素在类别资产配置、市场资产配置、券种选择3个层面进行主动性投资管理。积极运用“久期管理”,动态调整组合的投资品种,以达到预期投资目标。

(3) 权证投资策略

对权证的投资建立在对标的证券和组合收益风险进行分析的基础之上,权证在基金的投资中将主要起到锁定收益和控制风险的作用。

以BS模型和二叉树模型为基础来对权证进行定价,并根据市场情况对定价模型和参数进行适当修正。

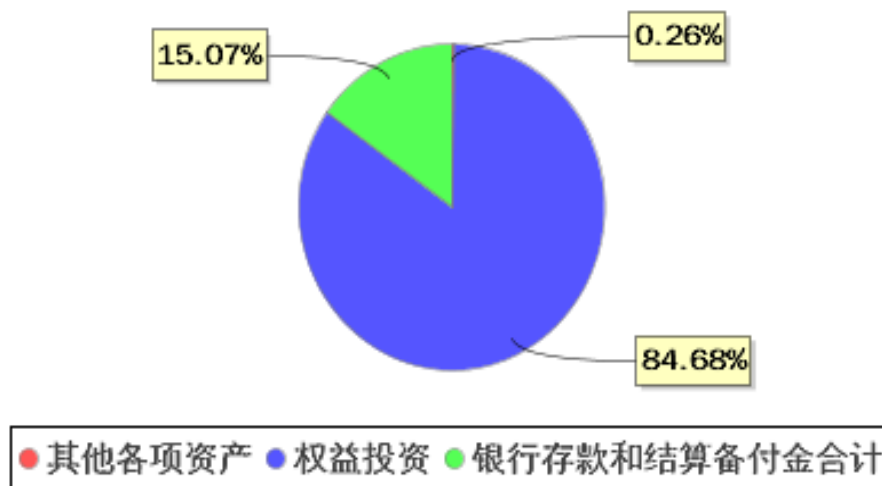
在组合构建和操作中运用的投资策略主要包括但不限于保护性看跌策略、抛补的认购权证、双限策略等。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×70%+标普中国债券指数收益率×30%

风险收益特征 本基金为混合型基金,长期平均风险介于股票型和债券型基金之间

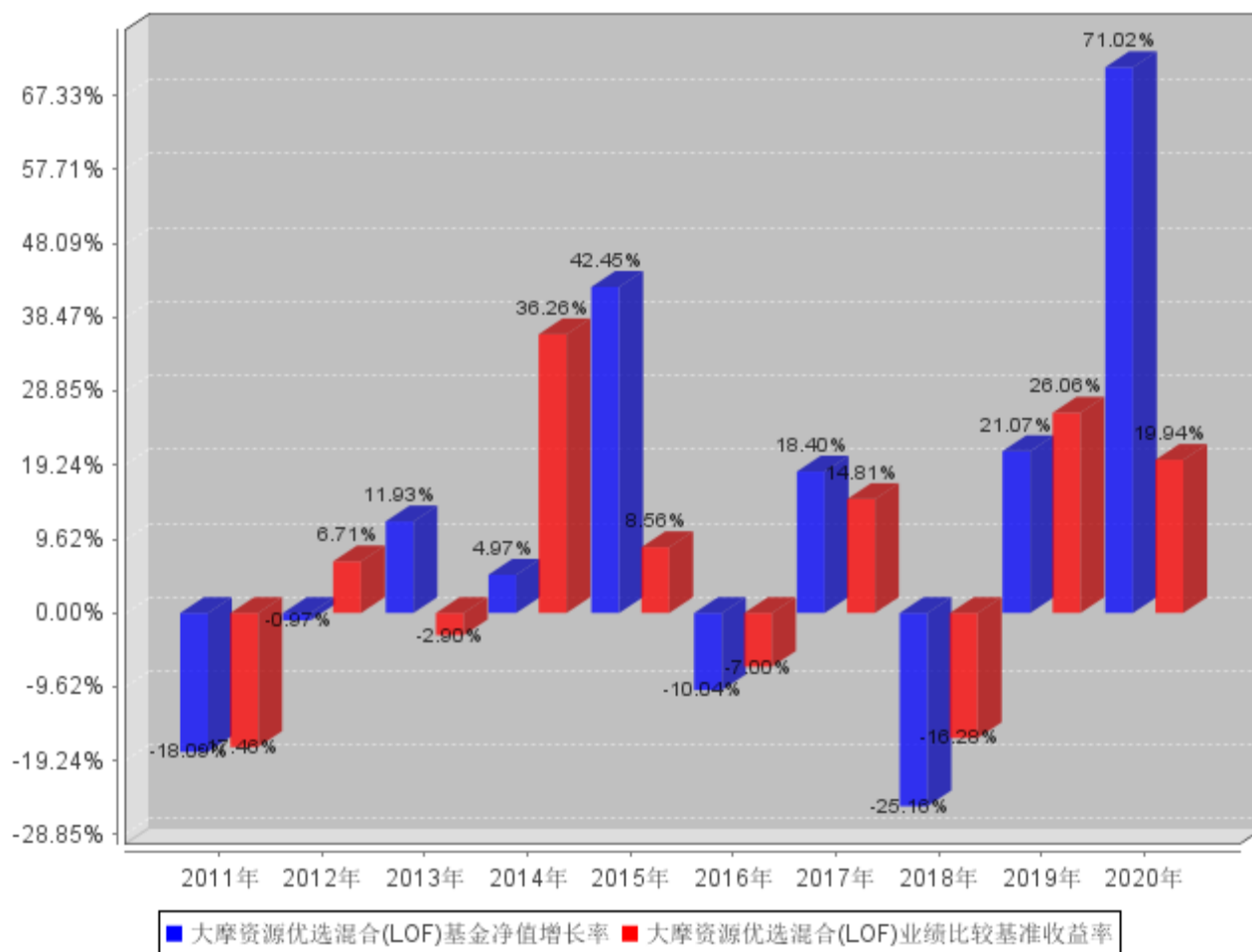
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2021年9月30日)



(三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

大摩资源优选混合(LOF)最近十年(孰短)基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：业绩表现截止日期2020年12月31日。基金过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

| 费用类型 | 份额(S)或金额(M)/持有期限(N) | 收费方式/费率 | 备注 |
|----------|---------------------|---------|----|
| 申购费(前收费) | M<100万 | 1.5% | |
| | 100万≤M<500万 | 1.0% | |
| | M≥500万 | 1000元/笔 | |
| 赎回费 | N<7日 | 1.5% | |
| | 7日≤N<365日 | 0.5% | |
| | 365日≤N<730日 | 0.25% | |
| | N≥730日 | 0% | |

申购费：本基金对于通过本公司直销中心申购本基金的养老金客户实施特定申购费率。费率详见《招募说明书》。

(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 | 1.50% |
| 托管费 | 0.25% |

注:本基金其他运作费用包括信息披露费用、会计师费、律师费、持有人大会费用等。本基金交易证券、基金等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

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,投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。基金风险表现为基金收益的波动,基金管理过程中任何影响基金收益的因素都是基金风险的来源。基金的风险按来源可以分为市场风险、管理风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、政策变更风险、本基金特有的风险、法律风险和其他风险等。

1、本基金特有风险

(1) 本基金为混合型基金,存在大类资产配置风险,有可能受到经济周期、市场环境或管理人对市场所处的经济周期和产业周期的判断不足等因素的影响,导致基金的大类资产配置比例偏离最优化水平,给基金投资组合的绩效带来风险。本基金在股票投资中重点投资资源类上市公司股票,这种评估具有一定的主观性,将在个股投资决策中给基金带来一定的不确定性的风险。该类型股票的波动会受到宏观经济环境、行业周期和公司自身经营状况等因素的影响。因此,本基金整体表现可能在特定时期内低于其他基金。此外,本基金以对资源类行业作为重点配置对象,也面临行业投资过于集中而带来的投资风险。本基金坚持价值和长期投资理念,重视股票投资风险的防范,但是基于投资范围的规定,本基金无法完全规避股票市场和债券市场的下跌风险。

(2) 上市交易的风险。本基金已在深圳证券交易所挂牌上市,由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌,投资人在停牌期间不能买卖基金份额,产生风险;同时,可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险;另外,当基金份额持有人将份额转向场外交易后导致场内的基金份额或持有人数不满足上市条件时,本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

(3) 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险。本基金在证券交易所的交易价格可能不同于基金份额净值,从而产生折价或者溢价的情况,虽然基金份额净值反映基金投资组合的资产状况,但是交易价格受到很多因素的影响,比如中国的经济情况、投资人的信心以及本基金的供需情况等。

(4) 本基金投资科创板的风险。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于科创板或选择不将基金资产投资于科创板,基金资产并非必然投资于科创板。

科创板股票在发行、上市、交易、退市制度等方面的规则与其他板块不同,除与其他投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还将面临以下风险:

1) 流动性风险:由于科创板股票的投资者门槛较高,股票流动性弱于A股其他板块,投资者可能在特定阶段对科创板个股形成一致性预期,因此存在基金持有股票无法正常交易的风险。

2) 退市风险:科创板的退市标准将比A股其他板块更加严格,且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市等环节,因此上市公司退市风险更大,可能给基金净值带来不利影响。

3) 系统性风险:科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业,在企业经营及盈利模式上存在趋同,所以科创板个股相关性较高,市场表现不佳时,系统性风险将更为显著。

4) 交易价格波动风险:科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制,首次公开发行上市的股票,上市后的前5个交易日不设涨跌幅限制,其后涨跌幅限制为20%,较宽的涨跌幅限制可能使得股票价格产生较大波动,从而导致本基金净值出现较大波动的风险。

(5) 本基金可能因持续规模较小或基金持有人人数不足等原因,导致基金转型、合并或终止的风险。

2、本基金特有风险外的其他风险请详见本基金的招募说明书。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的核准，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。

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站【www.msfnfunds.com.cn】【客服电话：400-8888-668】

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