

上投摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 基金产品资料概要更新

编制日期：2022年9月29日

送出日期：2022年9月30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	上投摩根恒生科技ETF(QDII)	基金代码	513890
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司 香港上海汇丰银行有限公司
境外投资顾问	-	境外托管人	The Hong Kong and Shanghai Banking Corporation Limited
基金合同生效日	2021-12-17	上市交易所及上市日期	上海证券交易所 2022-01-21
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	张军	开始担任本基金基金经理的日期	2021-12-17
		证券从业日期	2004-06-01
	胡迪	开始担任本基金基金经理的日期	2021-12-30
		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	2021-12-30
		证券从业日期	2014-07-11
其他	1. 本基金二级市场交易简称为HK科技（扩位简称：恒生科技HKETF）。 2. 本基金为股票型指数证券投资基金、QDII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四章“基金的投资”。

投资目标

本基金采用被动指数化投资，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

基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。其余资产可投资于其他金融产品或工具；

境外投资工具包括：与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国

家或地区证券监管机构登记注册的与本基金跟踪同一标的指数的公募基金、其他香港联合交易所上市股票（含港股通标的股票）、经中国证监会认可的境外交易所上市交易的衍生工具（期货、期权等）、债券、货币市场工具。

境内投资工具包括：国内依法发行或上市股票、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、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债等）、资产支持证券、同业存单、银行存款、债券回购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）。

其中在投资香港市场时，本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。

基金管理人根据相关规定可参与境内融资、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。

在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的80%，且不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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。

本基金的标的指数为恒生科技指数（HSTECH），及其未来可能发生的变更。

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80%，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，当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红、长期停牌等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金经理将配合使用其他合理的投资方法作为完全复制法的补充，构建本基金实际的投资组合，以追求尽可能贴近标的指数的表现，有效控制跟踪误差。本基金将根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代，以期在规定的风险承受限度内，尽量缩小跟踪误差。

（2）投资组合调整

1) 定期调整

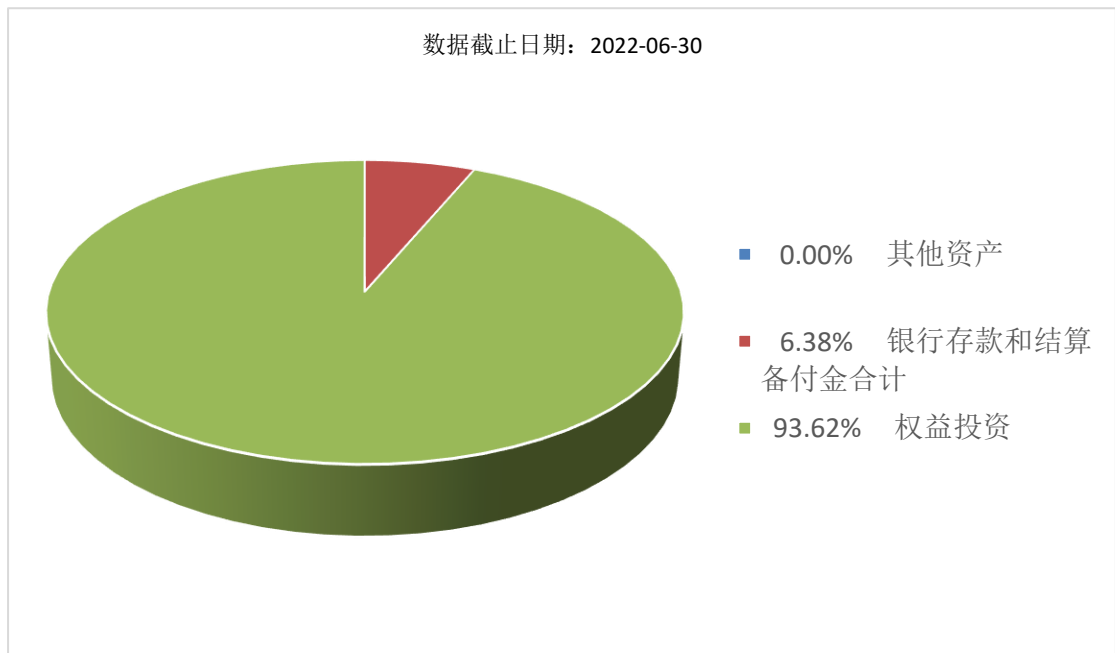
本基金所构建的投资组合将定期根据所跟踪标的指数成份股的调整进行相应的跟踪调整。指数调整方案公布后，本基金将及时对现有组合的构成进行相应的调整，若成份股的集中调整短期内会对跟踪误差产生较大影响，将采用逐步调整的方式。

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

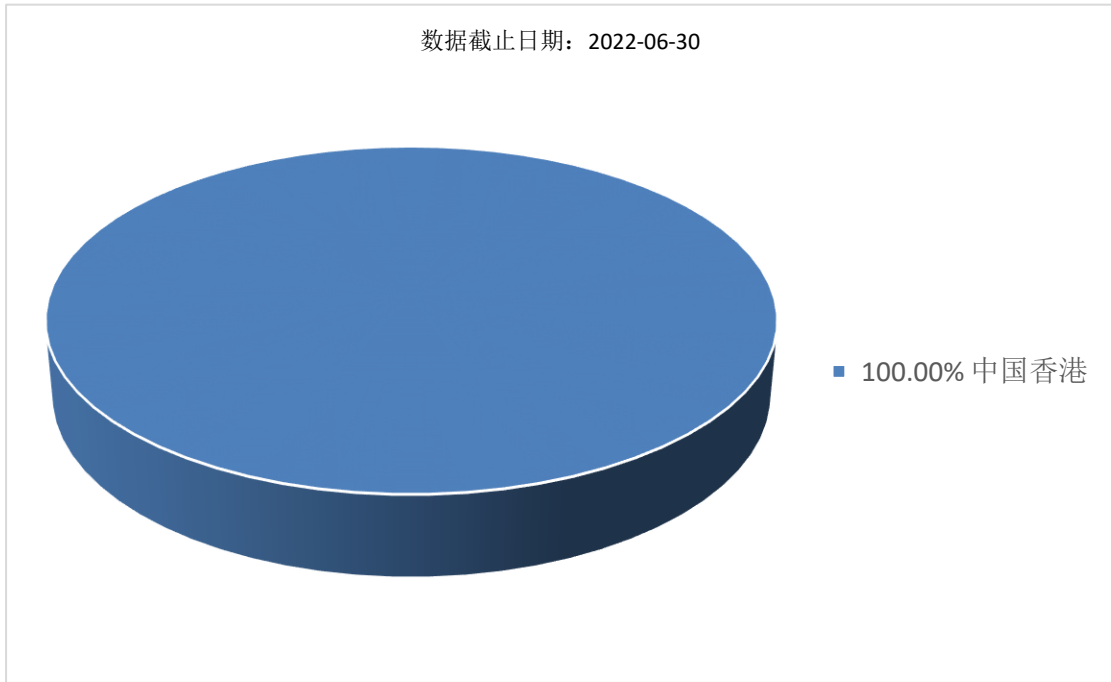
	<p>需进行成份股权重调整时，本基金将根据标的指数权重比例的变化，进行相应调整。</p> <p>②当标的指数成份股因停牌、流动性不足等因素导致基金无法按照指数权重进行配置，基金管理人将综合考虑跟踪误差和投资者利益，选择相关股票进行适当的替代。</p> <p>③本基金将根据申购和赎回情况对股票投资组合进行调整，保证基金正常运行，从而有效跟踪标的指数。</p> <p>(3) 在特殊情况下，本基金将综合考虑政策、市场等因素，在本合同约定的投资比例和投资范围内，将少量投资于非成份股的港股通标的股票以及其他股票。</p> <p>本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因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。</p> <p>3、其他投资策略：包括金融衍生品投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借策略、存托凭证投资策略。</p>
业绩比较基准	<p>本基金的业绩比较基准为经估值汇率调整的恒生科技指数（HSTECH）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。</p>
风险收益特征	<p>本基金属于股票基金，预期风险和收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。同时，本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p> <p>本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p>

(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



区域配置图表

数据截止日期：2022-06-30



(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

本基金合同生效日为2021年12月17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，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用；
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	0.50%
托管费	0.15%
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：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、本基金的风险主要包括：

- (1) 投资风险
- (2) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险
- (3) 标的指数波动的风险
- (4) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险：以下因素可能使基金投资组合的

收益率与标的指数的收益率发生偏离：①由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。②由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。③成份股派发现金红利将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。④由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。⑤由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。⑥在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度。⑦其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差；因政策政策、管控、及其他管理人不可控因素等导致本基金无法投资于部分指数成分股，从而导致基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

- (5) 跟踪误差控制未达约定目标的风险
- (6) 指数编制机构停止服务的风险
- (7) 标的指数变更的风险
- (8) 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险
- (9) 参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险
- (10) 成份股停牌的风险
- (11) 成份股退市的风险
- (12) 退市风险
- (13) 申购和赎回风险
- (14) 第三方机构服务的风险
- (15) 代理申赎投资者买券卖券的风险
- (16) 通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港市场股票的风险
- (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) 证券公司短期公司债的投资风险
- (21) 投资于存托凭证的风险
- (22) 参与融资及转融通证券出借业务的风险
- (23) 流动性风险

(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、诚实守信、谨慎勤勉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。

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当事人。

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，按照上海国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

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