

华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金（MSCIETF 联接 A 份额）

基金产品资料概要（更新）

编制日期：2021 年 3 月 31 日

送出日期：2021 年 3 月 31 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 | MSCIETF联接 | 基金代码 | 006286 |
| 下属基金简称 | MSCIETF联接A | 下属基金代码 | 006286 |
| 基金管理人 | 华泰柏瑞基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2018-10-10 | | |
| 基金类型 | 股票型 | 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 | 柳军 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2018-10-10 |
| | | 证券从业日期 | 2001-05-25 |
| 其他 | 基金合同生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。 | | |

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。 |
| 投资范围 | 本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括目标ETF、标的指数成份股及备选成份股、非成份股、存托凭证、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、货币市场工具以及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的相关规定）。本基金资产中投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。股指期货以套期保值为目的，权证、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。 |
| 主要投资策略 | 在正常市场情况下，本基金与业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%， |

年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致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、跟踪误差进一步扩大。本基金将综合运用存托凭证投资策略、股指期货投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略以更好的管理基金资产，实现投资目标。

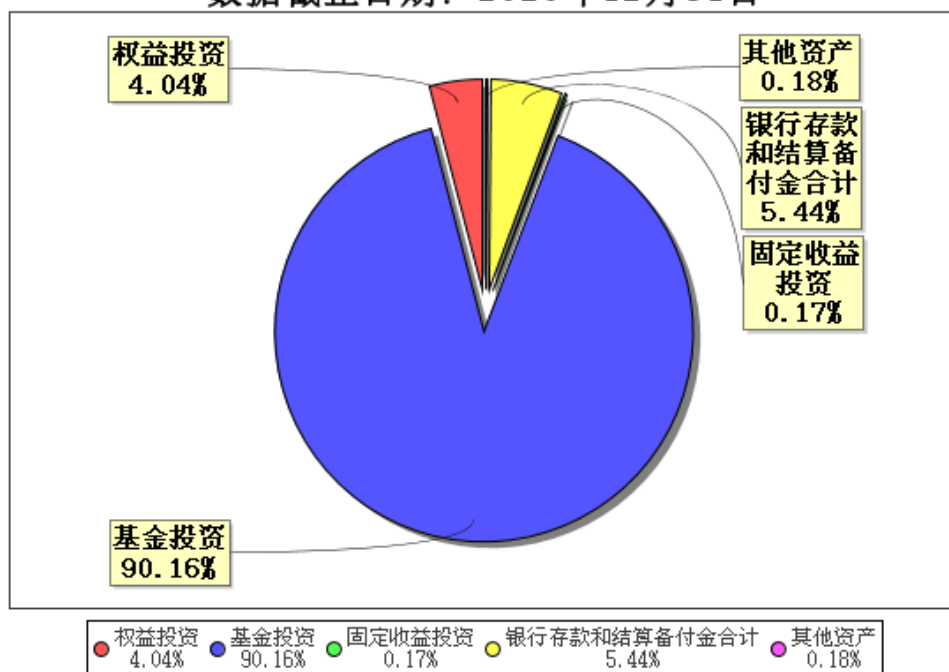
业绩比较基准 MSCI中国A股国际通指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%

风险收益特征 本基金为华泰柏瑞MSCI中国A股国际通ETF的联接基金，采用主要投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与MSCI中国A股国际通指数的表现密切相关。本基金的风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

注：详见《华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

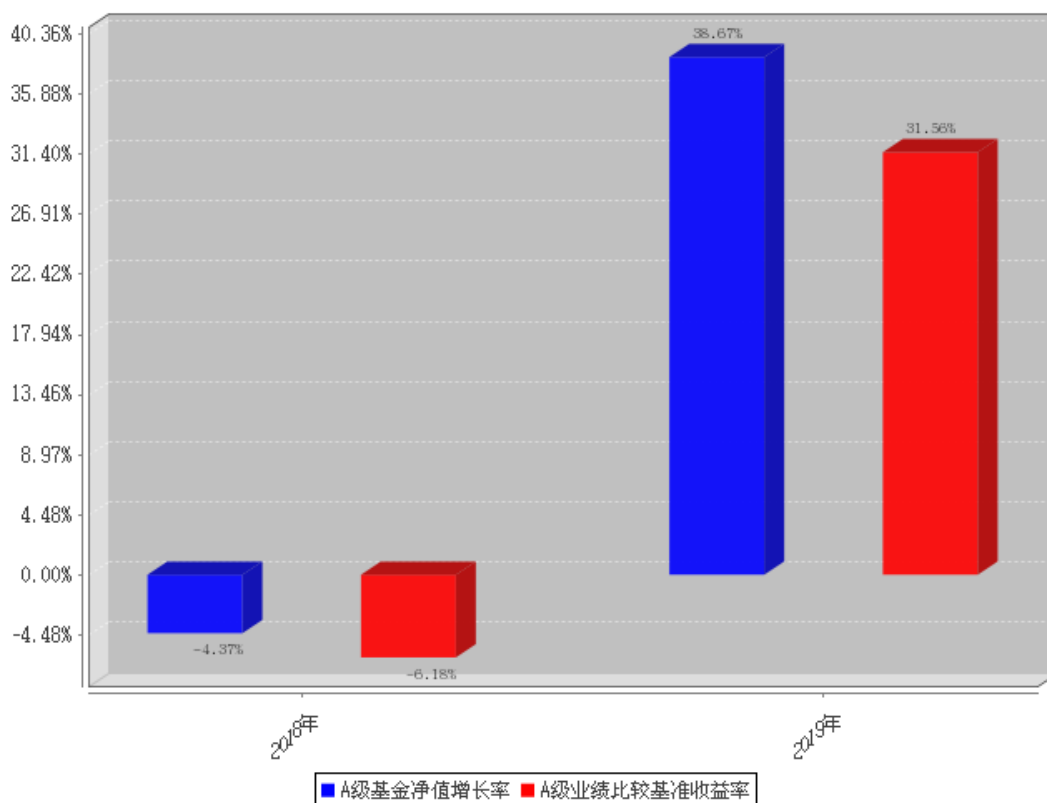
（二）投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表
数据截止日期：2020年12月31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

A级自基金合同生效以来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2019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 < 1,000,000 | 1.2% | |
| | 1,000,000 ≤ M < 3,000,000 | 1% | |
| | 3,000,000 ≤ M < 5,000,000 | 0.8% | |
| | M ≥ 5,000,000 | 1000元/笔 | |
| 赎回费 | N < 7天 | 1.5% | |
| | 7天 ≤ N < 365天 | 0.5% | |
| | 365天 ≤ N < 730天 | 0.25% | |
| | N ≥ 730天 | 0% | |

（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% |

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；基金费用包含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其他费用。

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。

投资于本基金的主要风险包括：

一）本基金的特定风险

作为一只股票指数联接型基金，本基金特有的风险主要包括被动跟踪指数的风险，主要表现在以下几方面：

1、指数下跌风险：即在市场下跌的情况下由于本基金跟踪指数而对基金净值造成损失的不确定性；

2、目标ETF的风险：即本基金的主要投资对象华泰柏瑞MSCI中国A股国际通ETF，其面临的风险可能直接或间接成为本基金的风险；

3、标的指数的风险：即标的指数因为编制方法的缺陷有可能导致标的指数的表现与总体市场表现的差异，因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大，增加基金投资成本，并有可能因此而增加跟踪误差，影响投资收益。

4、跟踪偏离风险：即基金在跟踪指数时由于各种原因导致基金的业绩表现与标的指数表现之间产生差异的不确定性。

5、基金投资科创板风险

基金资产投资科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特定风险，包括但不限于：

1）退市风险；2）市场风险；3）流动性风险；4）系统性风险；5）政策风险。

6、存托凭证投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证。存托凭证是新证券品种，本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特定风险。

本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份券停牌等潜在风险。

二）开放式基金共有的风险如投资组合的风险、管理风险、投资合规性风险和其他风险。

（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。

五、其他资料查询方式

以下资料详见华泰柏瑞基金官方网站 [www.huatai-pb.com] [客服电话：400-888-0001]

《华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、

《华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》、

《华泰柏瑞MSCI中国A股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》

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