

摩根中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2024年6月27日

送出日期：2024年6月28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	摩根中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期	基金代码	019683
基金管理人	摩根基金管理（中国）有限公司	基金托管人	交通银行股份有限公司
基金合同生效日	2023-12-18		
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	其他开放式	开放频率	每个开放日开放申购，但对每份基金份额设置 7 天的最短持有期限
基金经理	鞠婷	开始担任本基金基金经理的日期	2023-12-18
		证券从业日期	2006-03-01
	邱林晶	开始担任本基金基金经理的日期	2023-12-22
		证券从业日期	2014-01-21
其他	基金合同生效后，连续 50 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，本基金将根据《基金合同》约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会。		

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八章“基金的投资”。

投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，为更好地实现投资目标，还可以投资于非成份券及备选成份券的其他同业存单、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、公司债、可分离交易可转债的纯债部分等）、非金融企业债务融资工具（包括短期融资券、超短期融资券、中期票据）、债券回购、银行存款、资产支持证券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相关规定）。 本基金不投资于股票等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可

	<p>转债的纯债部分除外)、可交换债券及其他带有权益属性的金融工具。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。</p> <p>基金的投资组合比例为:本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的80%,投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于非现金基金资产的80%;本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如法律法规或中国证监会允许,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
主要投资策略	<p>本基金为指数基金,主要采用抽样复制和动态最优化的方法,投资于标的指数中具有较高的代表性和流动性的成份券和备选成份券,或选择非成份券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标指数的有效跟踪。</p> <p>在正常市场情况下,本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,将年化跟踪误差控制在2%以内。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了上述范围,基金管理人应采取合理措施,避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金主要通过以下投资策略进行投资:1、资产配置策略;2、抽样复制策略;3、替代性策略;4、资产支持证券投资策略。</p>
业绩比较基准	中证同业存单AAA指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	<p>本基金预期风险与预期收益低于股票型基金、偏股混合型基金,高于货币市场基金。</p> <p>本基金为指数型基金,主要采用抽样复制和动态最优化的方法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。</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

无

(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

无

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

本基金基金份额不收取认购、申购、赎回费用。

(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/年费率或金额	收费方
管理费	0.20%	基金管理人、销售机构
托管费	0.05%	基金托管人

销售服务费	0.20%	销售机构
审计费用	114,000.00	会计师事务所
信息披露费	80,000.00	规定披露报刊
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.审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

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、投资本基金的风险：

(1) 市场风险

主要的风险因素包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、证券发行公司经营风险、购买力风险。

(2) 管理风险

(3) 流动性风险

(4) 特定风险

1) 本基金对每份基金份额设置 7 天的最短持有期，对投资者存在流动性风险。本基金主要运作方式设置为允许投资者每个开放日申购，但对于每份基金份额设定最短持有期限，最短持有期限内基金管理人就不该基金份额办理赎回或转换转出确认。即投资者要考虑在最短持有期限届满前资金不能赎回或转换转出的风险。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 1 个月开始办理赎回，对投资者存在流动性风险。投资者可能面临基金份额在基金合同生效之日起 1 个月内不能赎回或转换转出的风险。

2) 指数化投资相关的风险

3) 标的指数的风险

4) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

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) 成份券停牌或违约的风险

8) 成份券退市或违约的风险

9) 信用风险

10) 基金合同直接终止的风险

(5) 资产支持证券的投资风险

(6) 启用侧袋机制的风险

(7) 操作或技术风险

(8) 合规性风险

(9) 基金管理人职责终止风险

(10) 其他风险

2、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,应提交上海国际经济贸易仲裁委员会,仲裁地点为上海市,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。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定,仲裁费用、律师费用由败诉方承担。

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: am.jpmorgan.com/cn 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