

# 摩根上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金

## 基金产品资料概要

编制日期：2025 年 9 月 8 日

送出日期：2025 年 9 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	摩根上证 AAA 科技创新公司债 ETF	基金代码	551300
基金管理人	摩根基金管理（中国）有限公司	基金托管人	中信证券股份有限公司
基金合同生效日	-	上市交易所及上市日期	上海证券交易所
基金类型	债券型	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	任翔	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	2014 年 9 月 3 日
其他	1. 本基金二级市场交易简称为科创债摩（扩位简称“科创债 ETF 摩根”），二级市场交易代码 551300。2. 基金合同生效后，连续五十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金合同终止，不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十一章“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，为了更好地实现投资目标，本基金还可以投资于债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可分离交易可转债的纯债部分等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货、信用衍生品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的相关规定）。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：本基金投资于债券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基金资产净值的 90%且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货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。

	如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，基金管理人履行适当程序后，对本基金的投资比例做出相应调整。 本基金的标的指数为上证 AAA 科技创新公司债指数。
<b>主要投资策略</b>	本基金为指数基金，主要采用抽样复制的方法，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。 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。 此外，本基金采用的投资策略还包括：资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、信用衍生品投资策略等。
<b>业绩比较基准</b>	本基金的业绩比较基准为标的指数，即上证 AAA 科技创新公司债指数收益率。
<b>风险收益特征</b>	本基金为债券型指数基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，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

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

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
认购费	$S < 50$ 万份	0.30%
	$50 \text{ 万份} \leq S < 100 \text{ 万份}$	0.15%
	$S \geq 100 \text{ 万份}$	每笔人民币 500 元

#### 认购费

基金管理人办理网下现金认购时按照上述所示费率收取认购费用，基金管理人办理网下债券认购时不收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下债券认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。

#### 申购费

投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 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。

#### 赎回费

投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过 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。

### (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	收取方
------	-------------	-----

管理费	0.15%	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
销售服务费	-	销售机构
审计费用	-	会计师事务所
信息披露费	-	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：本基金交易证券、期货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、投资于本基金的特定风险包括：

- (1) 标的指数回报与债券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：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券或变更编制方法，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由于标的指数成份券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成份券付息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由于成份券违约、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等的存在，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由于政策、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份券，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。⑦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。⑧本基金采用抽样复制策略和替代性策略，投资于标的指数成份债券和备选成份债券中流动性较好的债券，或选择非成份券作为替代，基金投资组合与标的指数构成可能存在差异，从而可能导致基金实际收益率与标的指数收益率产生偏离。⑨其他因素产生的偏离。如因受到最低买入债券数的限制，基金投资组合中个别债券的持有比例与标的指数中该债券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。

- (4) 跟踪误差控制未达约定目标的风险
- (5) 指数编制机构停止服务的风险
- (6) 标的指数变更的风险
- (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) 成份券违约的风险
- (10) 成份券停牌的风险
- (11) 基金退市风险
- (12) 投资者申购失败的风险
- (13) 投资者赎回失败的风险
- (14) 基金份额赎回对价的变现风险
- (15) 申购赎回清单差错风险
- (16) 申购赎回的代理买卖风险

- (17) 第三方机构服务的风险
- (18) 国债期货的投资风险
- (19) 资产支持证券的投资风险
- (20) 信用衍生品的投资风险
- (21) 基金合同提前终止的风险
- (22) 基金管理人职责终止风险

## 2、市场风险

## 3、流动性风险

## 4、其他风险

- (1) 管理风险与操作风险
- (2) 技术风险
- (3) 不可抗力

## 5、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，仲裁费用由败诉方承担。

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](http://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

## 六、其他情况说明

无