

# 上投摩根欧洲动力策略股票型证券投资基金（QDII）

## 基金产品资料概要更新

编制日期：2021年6月10日

送出日期：2021年6月11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    | 上投摩根欧洲动力策略股票（QDII）                                       | 基金代码           | 006282                                                                 |
| 基金管理人   | 上投摩根基金管理有限公司                                             | 基金托管人          | 招商银行股份有限公司                                                             |
| 境外投资顾问  | 摩根资产管理（英国）有限公司<br>JPMorgan Asset Management (UK) Limited | 境外托管人          | 香港上海汇丰银行有限公司<br>The Hong Kong and Shanghai Banking Corporation Limited |
| 基金合同生效日 | 2018-10-31                                               |                |                                                                        |
| 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    | 张军                                                       | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2018-10-31                                                             |
|         |                                                          | 证券从业日期         | 2004-06-01                                                             |

### 二、基金投资与净值表现

#### （一）投资目标与投资策略

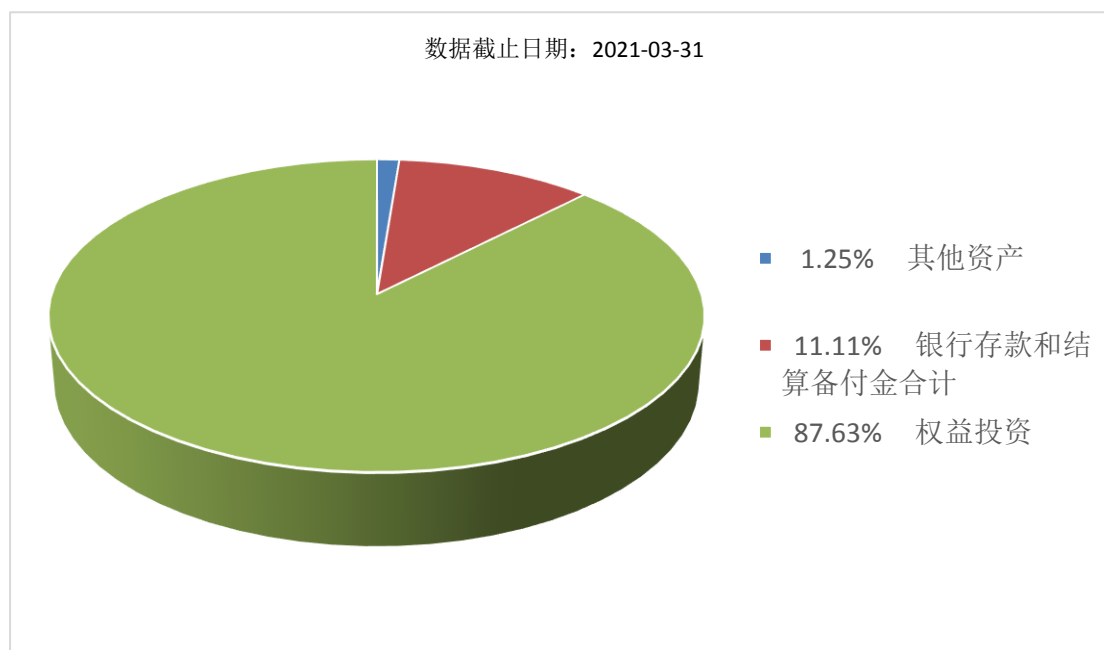
投资者欲了解详细情况，请阅读招募说明书第四章“基金的投资”。

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金主要投资于欧洲股票，在严格控制风险的前提下追求超越业绩比较基准的回报。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 投资范围 | 本基金在境外的投资范围如下：<br>本基金境外主要投资于欧洲上市公司股票，此外，本基金还可投资于银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已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市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证；已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公募基金；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品。<br>本基金在境内的投资范围如下： |

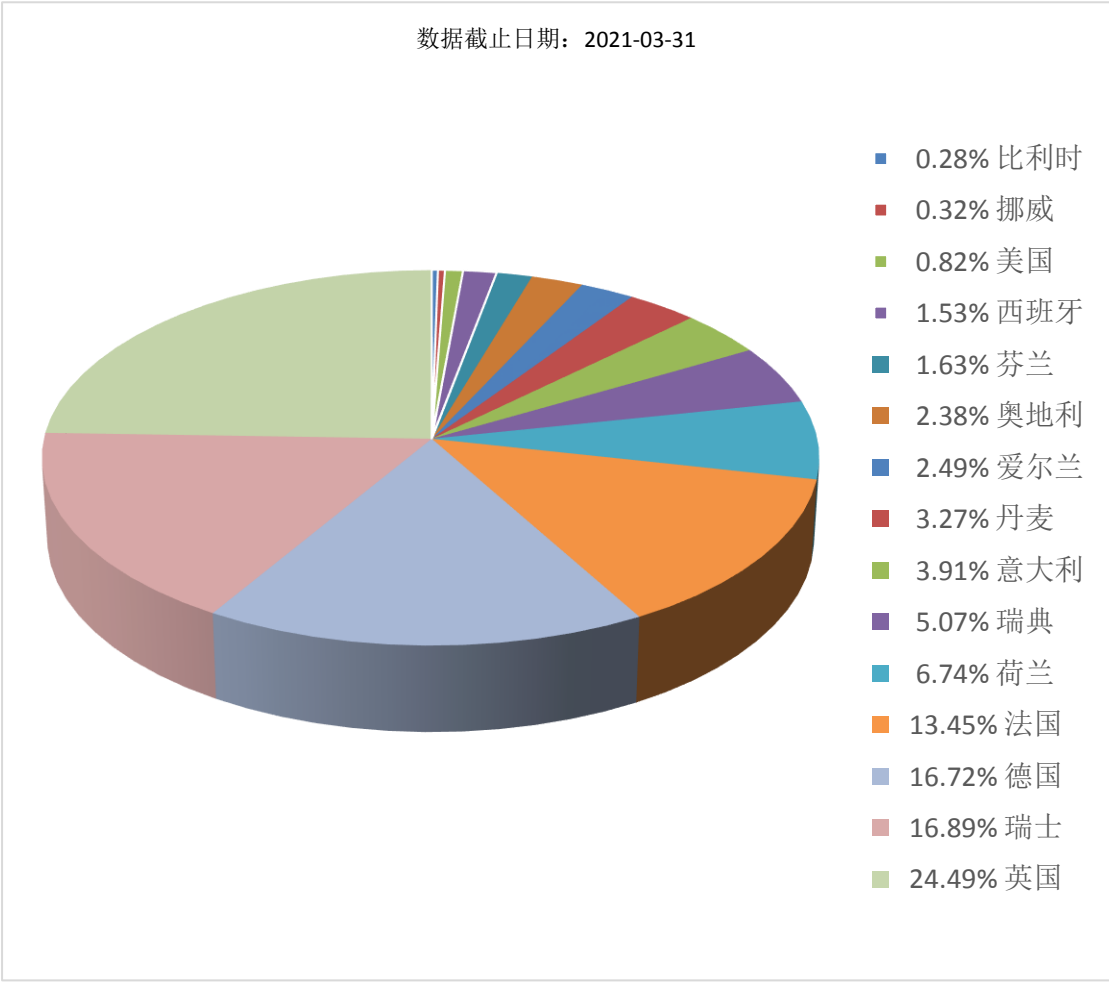
|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>本基金境内主要投资于具有良好流动性的金融工具，具体包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、地方政府债、公开发行的次级债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款等，及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。</p> <p>本基金投资组合中股票资产占基金资产的 80%-95%，其中投资于欧洲上市公司股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金类资产不包括结算备付金、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> |
| 主要投资策略 | <p>本基金将根据欧洲资本市场情况、企业竞争优势等进行综合分析、评估，精选优秀的欧洲企业进行跨市场配置以构建股票投资组合。本基金综合考虑欧洲地区不同市场的宏观经济环境、增长和通胀背景、不同市场的估值水平和流动性因素、相关公司所处的发展阶段、盈利前景和竞争环境以及其他影响投资组合回报及风险的重要要素将基金资产在欧洲市场之间进行配置，并从估值、股票质量及趋势三个维度在欧洲上市公司股票中进行筛选。本基金还将综合分析企业的财务状况、商业模式以及公司管理层三个方面，从中筛选出优秀的上市公司，结合各项定量和定性指标挑选出最具上涨潜力的标的自下而上构建投资组合。</p>                                                                                |
| 业绩比较基准 | <p>本基金的业绩比较基准：<math>90\% \times \text{MSCI 欧洲净收益指数 (MSCI Europe Index (Total Return Net)) 收益率} + 10\% \times \text{税后银行活期存款收益率}</math></p>                                                                                                                                                                                                                               |
| 风险收益特征 | <p>本基金属于股票型基金产品，预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</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

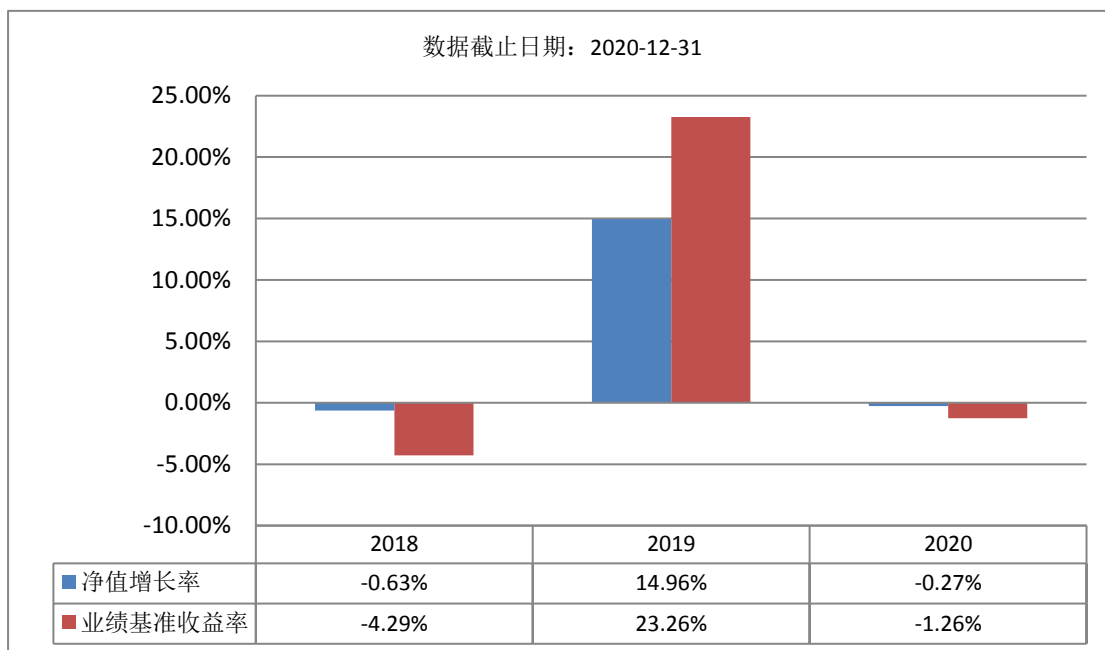


区域配置图表



注：1. 图示范围为报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布；  
2. 国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定，ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。  
3. 图示百分比为公允价值占股票及存托凭证的公允价值合计数比例（%）

**(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**



注：本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)<br>/持有期限 (N)              | 收费方式/费率  | 备注 |
|-----------|------------------------------------------|----------|----|
| 申购费 (前收费) | $0 \text{ 元} \leq M < 100 \text{ 万元}$    | 1.50%    |    |
|           | $100 \text{ 万元} \leq M < 500 \text{ 万元}$ | 1.00%    |    |
|           | $M \geq 500 \text{ 万元}$                  | 1000 元/笔 |    |
| 赎回费       | $0 \text{ 天} \leq N < 7 \text{ 天}$       | 1.50%    |    |
|           | $7 \text{ 天} \leq N < 30 \text{ 天}$      | 0.75%    |    |
|           | $30 \text{ 天} \leq N < 365 \text{ 天}$    | 0.50%    |    |
|           | $1 \text{ 年} \leq N < 2 \text{ 年}$       | 0.35%    |    |
|           | $2 \text{ 年} \leq N < 3 \text{ 年}$       | 0.20%    |    |
|           | $N \geq 3 \text{ 年}$                     | 0.00%    |    |

#### （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  | 1.80%                        |
| 托管费  | 0.25%                        |
| 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。

#### （一）境外投资风险

证券市场价格会因为国际政治环境、宏观和微观经济因素、国家政策、投资人风险收益偏好和市场流动程度等各种因素的变化而波动，将对本基金资产产生潜在风险，这种风险主要包括：

- 1、海外市场风险
- 2、政治风险
- 3、经济周期风险
- 4、汇率风险
- 5、利率风险

#### （二）基金运作风险

- 1、流动性风险
- 2、操作风险
- 3、大额赎回风险
- 4、交易结算风险
- 5、会计核算风险
- 6、税务风险
- 7、金融模型风险
- 8、衍生品投资风险
- （1）衍生品流动性风险
- （2）衍生品操作风险
- （3）法律风险
- 9、信用风险
- 10、启用侧袋机制的风险
- 11、不可抗力风险

#### （三）本基金特定风险

##### 1、本基金拟投资市场及资产的特有风险

本基金主要投资于欧洲市场，因此一方面基金净值会因欧洲股票市场的整体变化而出现价格波动。另一方面由于欧洲所特有的政治因素、法律法规、市场状况、经济发展趋势等也将对基金的业绩产生影响。另外由于欧洲国家的证券交易市场对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，使得证券的每日涨跌幅空间相对较大。以上所述因素可能会带来市场的急剧下跌，从而导致投资风险的增加。

##### 2、本基金拟投资资产的特有风险

本基金作为股票型基金，在投资管理中会至少维持 80%的股票投资比例，具有对股票市场的系统性风险，不能完全规避市场下跌的风险和个股风险，在市场大幅上涨时也不能保证基金净值能够完全跟随或超越市场上涨幅度。

##### 3、境外证券投资额度限制引致的风险

本基金将按照中国证监会和外管局核准的额度设定基金募集期内的募集规模上限。基金合同生效后，基金的资产规模不受上述限制，但基金管理人有权根据基金的境外证券投资额度控制基金申购规模并暂停基金的申购。

##### 4、证券公司短期公司债券投资风险

由于证券公司短期公司债券非公开发行和交易，且限制投资者数量上限，潜在流动性风险相对较大。若发行主体信用质量恶化或投资者大量赎回需要变现资产时，受流动性所限，

本基金可能无法卖出所持有的证券公司短期公司债券，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。

#### 5、中小企业私募债投资风险

中小企业私募债发行人为中小微、非上市企业，存在着公司治理结构相对薄弱、企业经营风险高、信息披露透明度不足等特点。基金管理人将通过建立并严格执行特定的信用分析制度，对持有的中小企业私募债投资进行信用风险管理。但如果发行人未真实披露其财务及经营管理信息，或基金管理人对其信用风险判断有误，中小企业私募债投资将存在违约风险，极端情况下，存在债券投资本金完全无法回收的风险。

同时，中小企业私募债交易平台为上交所与深交所的特定平台或通过证券公司进行转让，可能存在流动性不足的风险。如果基金管理人持有的中小企业私募债投资未能持有到期，将可能在二级市场交易时承担相当幅度的流动性折价，从而影响基金的收益水平。因此，投资中小企业私募债将在一定程度上增加基金的信用风险和流动性风险。

#### 6、资产支持证券投资风险

本基金投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

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。

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华南国际经济贸易仲裁委员会，按照华南国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。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：[www.cifm.com](http://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