

上投摩根MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金（上投摩根MSCI中国A股ETF联接C）基金产品资料概要更新

编制日期：2021年6月23日

送出日期：2021年6月24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 MSCI 中国 A 股 ETF 联接	基金代码	008944
下属基金简称	上投摩根 MSCI 中国 A 股 ETF 联接 C	下属基金代码	008945
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司	基金托管人	平安银行股份有限公司
基金合同生效日	2020-07-22		
基金类型	其他类型	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	胡迪	开始担任本基金基金经理的日期	2021-01-07
		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	2021-02-19
		证券从业日期	2014-07-11
其他	本基金为指数基金、联接基金。		

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八章“基金的投资”。

投资目标	通过对目标ETF基金份额的投资，追求跟踪标的指数，获得与指数收益相似的回报。
投资范围	本基金主要投资于目标ETF、标的指数成份股及备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、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、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单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）。 本基金将根据法律法规的规定参与融资及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。 本基金投资于目标ETF基金份额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和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，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%，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。
主要投资策略	本基金为上投摩根MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，通过将基金资产主要投资于目标ETF基金份额，以实现对标指数的跟踪。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或其他因素导致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误差进一步扩大。 基金也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。为了提高投资效率，基金还可以根据风险管理原则，少量投资于股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的衍生工具等。 1、目标ETF投资策略 为了实现跟踪误差最小化，本基金投资于目标ETF基金份额的比例不低于基金资产净值的90%。 2、股票投资策略 为更好地跟踪标的指数，本基金也可以通过被动指数化的方法买入标的指数成份股，根据成份股在标的指数中的基准权重构建组合，对于因法规限制、流动性限制而无法交易的成份股，将采用与被限制股预期收益率相近的股票或股票组合进行相应的替代。 3、金融衍生品投资策略 本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。 4、债券投资策略 本基金进行债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。 5、资产支持证券投资策略 本基金综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量等因素，主要从资产池信用状况、违约相关性、历史违约记录和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估，在严格控制风险的情况下，确定资产合理配置比例，在保证资产安全性的前提条件下，以期获得长期稳定收益。 6、融资及转融通证券出借策略 本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。 7、存托凭证投资策略 本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。
业绩比较基准	MSCI中国A股人民币指数收益率×95%+活期存款利率（税后）×5%。 若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，基金管理人可根据投资情况和市场惯例调整基金业绩比较基准的组成和权重，但基金管理人应取得基金托管人同意后，并在履行适当程序后及时公

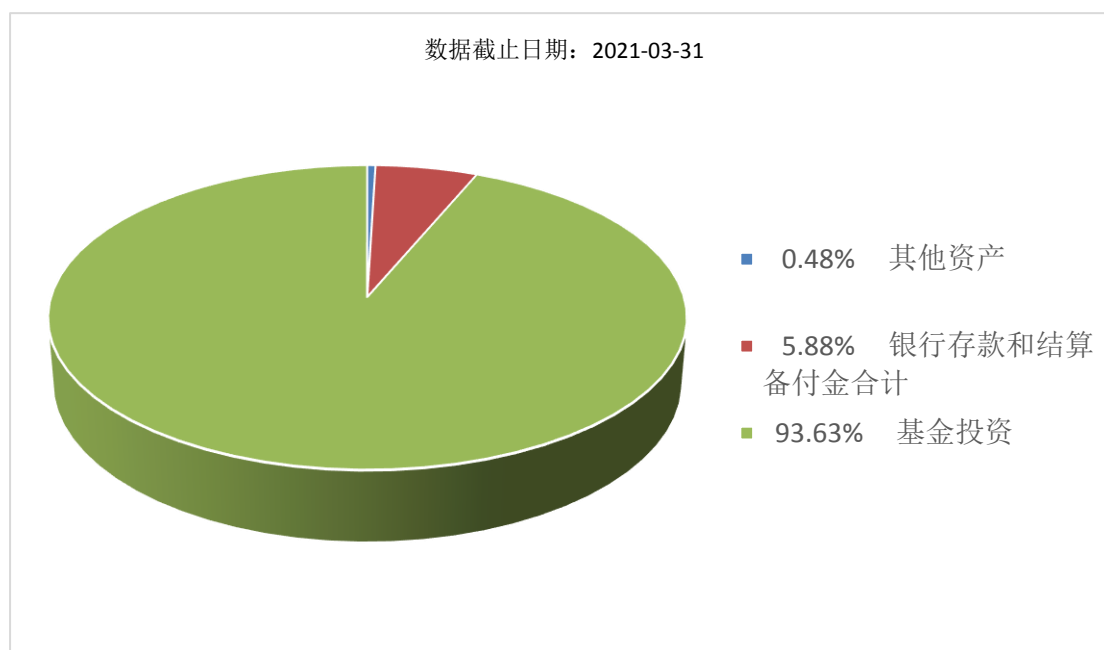
告。

风险收益特征

本基金为ETF联接基金，具有与目标ETF相似的风险收益特征。目标ETF为股票型指数基金，因此本基金的预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，且具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

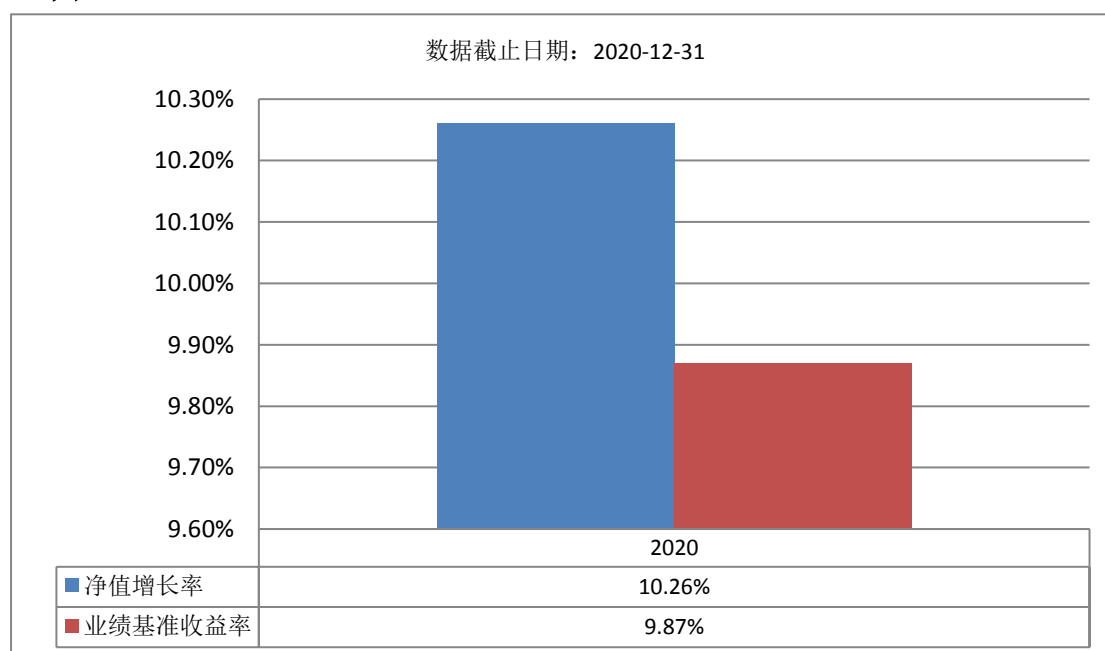
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表



注：本基金合同生效日为2020年7月22日，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

(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：本基金合同生效日为2020年7月22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

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	备注
赎回费	$0 \text{ 天} \leq N < 7 \text{ 天}$	1.50%	
	$N \geq 7 \text{ 天}$	0.00%	

注：本基金份额的申购费率为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%
销售服务费	0.10%
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、投资于本基金的主要风险包括：

- （一）联接基金风险
- （二）跟踪偏离风险
- （三）与目标 ETF 业绩差异的风险
- （四）跟踪误差控制未达约定目标的风险
- （五）标的指数变更的风险
- （六）其他投资于目标 ETF 的风险
- （七）指数编制机构停止服务的风险
- （八）成份股停牌的风险
- （九）成份股退市的风险
- （十）资产支持证券的投资风险
- （十一）股指期货的投资风险
- （十二）股票期权的投资风险
- （十三）参与融资及转融通证券出借业务的风险
- （十四）市场风险
- （十五）流动性风险
- （十六）存托凭证的投资风险
- （十七）启用侧袋机制的风险

二、其他风险

- （一）管理风险与操作风险
- （二）技术风险
- （三）不可抗力

三、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，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为上海市，按照该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，仲裁费用及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：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