

# 摩根恒生科技交易型开放式指数证券投资基金发起式 联接基金(QDII) (摩根恒生科技ETF发起式联接 (QDII)A) 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	摩根恒生科技 ETF 发起式联接(QDII)	基金代码	018577
下属基金简称	摩根恒生科技 ETF 发起式联接(QDII)A	下属基金代码	018577
基金管理人	摩根基金管理(中国)有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司 香港上海汇丰银行有限公司
境外投资顾问	-	境外托管人	The Hong Kong and Shanghai Banking Corporation Limited
基金合同生效日	2023-07-18		
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	毛时超	开始担任本基金基金经理的日期	2023-07-18
		证券从业日期	2016-07-05
其他	1.本基金为指数基金、联接基金。 2.《基金合同》生效日起3年后的对应日，若基金资产净值低于2亿元的，基金合同自动终止，同时不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充时，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。《基金合同》生效3年后继续存续的，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50个工作日出现前述情形的，基金合同终止，不需召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。		

## 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。

本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数成份股、备选成份股。其余资产可投资于其他金融产品或工具：

境外投资工具包括：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与本基金跟踪同一标的指数的公募基金、其他香港联合交易所上市的股票（含港股通标的股票）、经中国证监会认可的境外交易所上市交易的衍生工具（期货、期权等）、债券、货币市场工具。

境内投资工具包括：国内依法发行或上市的股票、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、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债等）、资产支持证券、同业存单、银行存款、债券回购、货币市场工具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）。

### 投资范围

其中在投资香港市场时，本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。

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%，其中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。

#### 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%。本基金主要通过申购、赎回或二级市场买卖的方式投资于目标ETF。当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整，无须召开基金份额持有人大会。本基金在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申赎的方式或二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。本基金还可适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回之间的套利，以增强基金收益。本基金可以基金资产特殊申购目标ETF份额，以进行基金建仓。

### 主要投资策略

#### 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。在投资运作过程中，本基金根据成份股构成及其权重的变动进行动态调整；在条件允许的情况下还可通过买入标的指数成份股、备选成份股以申购目标ETF。

#### 3、港股通标的股票投资策略

#### 4、金融衍生品投资策略

#### 5、债券投资策略

	6、可转换债券和可交换债券投资策略 7、资产支持证券投资策略 8、存托凭证投资策略 9、证券公司短期公司债券投资策略 10、融资及转融通证券出借策略
<b>业绩比较基准</b>	经估值汇率调整的恒生科技指数收益率×95% + 活期存款利率（税后）×5%
<b>风险收益特征</b>	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。 本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

## （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

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
申购费 (前收费)	0 元 ≤ M < 100 万元	1.20%	
	100 万元 ≤ M < 500 万元	0.60%	
	M ≥ 500 万元	1000 元/笔	
赎回费	0 天 ≤ N < 7 天	1.50%	
	N ≥ 7 天	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/年费率或金额	收费方
管理费	0.50%	基金管理人、销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
审计费用	30,000.00	会计师事务所
信息披露费	50,000.00	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、期货等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。2.本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分的年费率计提。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分的年费率计提。

3.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。

### (三) 基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

基金运作综合费率（年化）
0.97%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次年报基金披露的相关数据为基准推算。

## 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、投资于本基金的主要风险包括：

(1) 投资境外市场的特有风险

1) 境外地区市场风险

2) 汇率风险

3) 法律和政治风险

4) 税务风险

5) 会计风险

6) 引入境外托管人的相关风险

(2) 指数化投资的风险

1) 指数波动的风险

2) 标的指数成份股主要集中于科技行业的集中度风险

3) 部分成份股权重较大的风险

4) 指数编制的风险

5) 基金收益率与业绩比较基准收益率偏离的风险，主要影响因素包括：目标 ETF 对指数的跟踪误差，本基金发生申购赎回、管理费和托管费收取等其他导致基金跟踪误差的情形

6) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

7) 指数编制机构停止服务的风险

8) 成份股停牌的风险

9) 成份股退市的风险

10) 恒生科技指数相关风险

(3) 联接基金的特殊风险

1) 由于本基金在投资限制、运作机制和投资策略等方面与目标 ETF 不同，因此本基金可能具有与目标 ETF 不同的风险收益特征及净值增长率。

2) 本基金属于联接基金，主要投资于目标 ETF，因此目标 ETF 面临的风险可能直接或间接成为本基金的风险，投资者应知悉并关注目标 ETF 招募说明书等文件中的风险揭示内容。

3) 基金由目标 ETF 的联接基金变更为直接投资目标 ETF 标的指数成份股的指数基金

的风险。当目标 ETF 发生基金合同约定的特殊情况时，本基金可能由目标 ETF 的联接基金变更为直接投资目标 ETF 标的指数成份股及备选成份股的指数基金，投资者届时须承担变更基金类型所带来的风险。

- (4) 通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于港股通标的股票的风险
  - (5) 资产支持证券的投资风险
  - (6) 股指期货的投资风险
  - (7) 股票期权的投资风险
  - (8) 证券公司短期公司债的投资风险
  - (9) 投资于存托凭证的风险
  - (10) 参与融资及转融通证券出借业务的风险
  - (11) 本基金自动终止的风险
  - (12) 流动性风险
  - (13) 启用侧袋机制的风险
- 2、其他风险，如管理风险、操作或技术风险、合规性风险、基金管理人职责终止风险
- 3、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。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：[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