

中金 MSCI 中国 A 股国际质量交易型开放式指数证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2025 年 3 月 18 日

送出日期：2025 年 3 月 21 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	质量 ETF	基金代码	515910
基金管理人	中金基金管理有限公司	基金托管人	招商证券股份有限公司
基金合同生效日	2021 年 1 月 21 日	上市交易所及上市日期	上海证券交易所 2021 年 02 月 26 日
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	耿帅军	开始担任本基金基金经理的日期	2021 年 01 月 21 日
		证券从业日期	2011 年 04 月 15 日
其他	场内简称：质量 ETF		

注：《基金合同》生效后，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，本基金应当按照基金合同的约定程序进行清算并终止，且无需召开基金份额持有人大会。

二、基金投资与净值表现

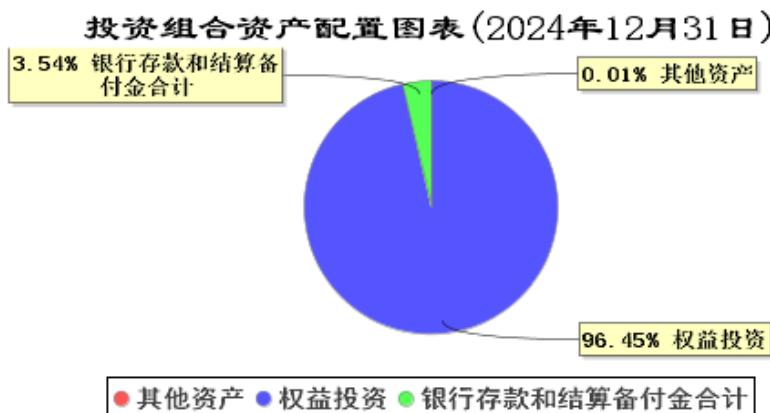
(一) 投资目标与投资策略

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资范围	标的指数：MSCI 中国 A 股国际质量指数 本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股(含中小板、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票)、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转换债券的纯债部分）、可交换债券、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权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）。 本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资、转融通证券出借业务。 本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股（存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%，且不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金在每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约和股票期权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。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

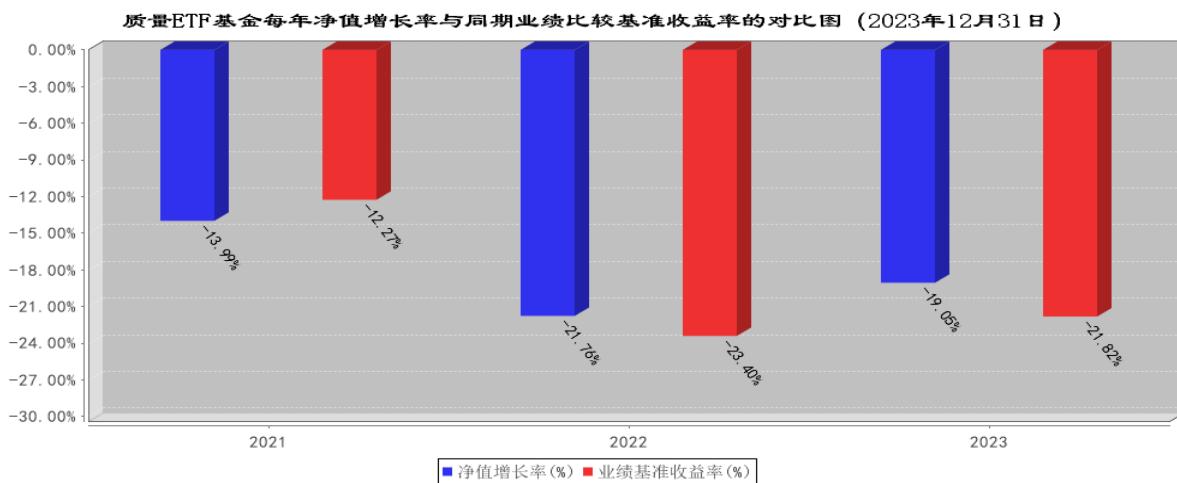
主要投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。其中包括：1、股票投资策略；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、股指期货投资策略；6、股票期权投资策略；7、国债期货投资策略；8、参与转融通证券出借和融资业务投资策略。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际质量指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制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股票市场相似的风险收益特征。

注：详见《中金 MSCI 中国 A 股国际质量交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》第十一部分“基金的投资”。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(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：业绩表现截止日期 2023 年 12 月 31 日。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
申购费 (前收费)	投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理机构可按照不超过 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，申购赎回代理机构可按照不超过 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。	

注：场内交易费用以证券公司实际收取为准。

(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	0.30%	基金管理人和销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
审计费用	45,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元	规定披露报刊
其他费用	费用的计算方式及支付方式详见招募说明书及相关公告	

注：(1) 本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。审计费用、信息披露费为年金额，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。

(2) 自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数许可使用费由基金资产承担调整为由基金管理人承担。

(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)	
持有期间	0.47%

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基金年报披露的相关数据为基准测算。

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，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

投资于本基金的主要风险有：

- 1、市场风险，主要包括：(1)政策风险；(2)经济周期风险；(3)利率风险；(4)债券收益率曲线风险；(5)上市公司经营风险；(6)购买力风险；(7)再投资风险；(8)债券回购风险；2、信用风险；3、流动性风险；4、管理风险；5、估值风险；6、操作及技术风险；7、合规性风险；8、其他风险；
- 9、本基金特有风险：(1)标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险；(2)成份股停牌的风险；(3)标的指数波动的风险；(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)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)退市风险；(10)投资者申购失败的风险；(11)投资者赎回失败的风险；(12)基金份额赎回对价的变现风险；(13)套利风险；(14)申购赎回清单差错风险；(15)

二级市场流动性风险；（16）第三方机构服务的风险；（17）退补现金替代方式的风险；（18）期货投资风险；（19）资产支持证券投资风险；（20）期权投资风险；（21）流动性受限证券投资风险；（22）转融通证券出借业务风险；（23）参与融资业务的风险；（24）存托凭证投资风险；（25）基金合同终止的风险。

（二）重要提示

本基金的募集申请于 2020 年 10 月 26 日经中国证监会证监许可[2020]2723 号文注册。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。

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临时相关公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站：www.ciccfund.com，客服电话：400-868-1166

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