

太平 MSCI 香港价值增强指数证券投资基金(C 类份额)

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	太平 MSCI 香港价值增强	基金代码	007107
下属基金简称	太平 MSCI 香港价值增强 C	下属基金交易代码	007108
基金管理人	太平基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2019 年 7 月 31 日	上市交易所及上市日期	-
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	林开盛	开始担任本基金基金经理的日期	2020 年 05 月 18 日
		证券从业日期	2009 年 07 月 16 日
其他	《基金合同》生效后，出现连续二十个工作日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，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。 法律法规另有规定时，从其规定。		

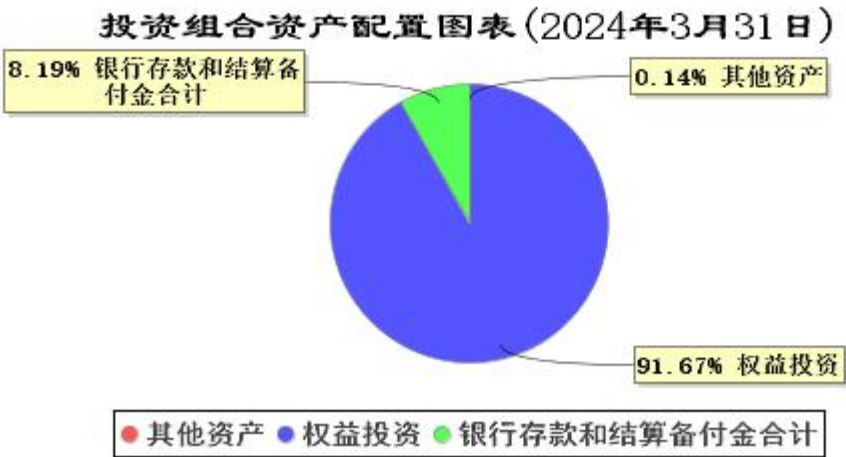
二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

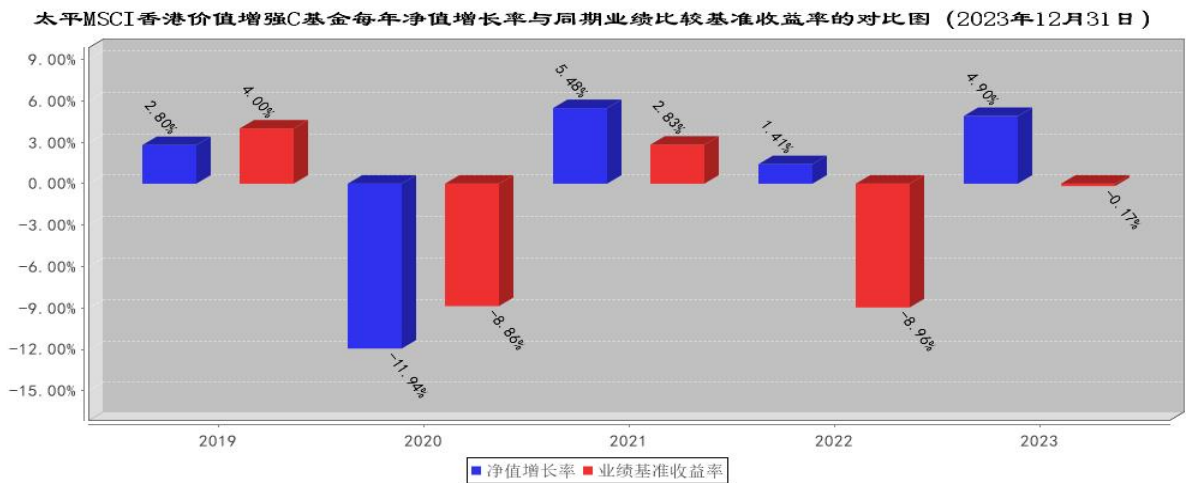
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资范围	本基金的投资范围主要为标的指数成分股、备选成分股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资非成分股（包括港股通标的股票和中国证监会核准发行上市的股票）、债券、债券回购、资产支持证券、权证、股指期货、同业存单、银行存款、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。
主要投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，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。

	本基金运作过程中，当指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的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%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和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偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	MSCI 香港价值增强指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金属股票型基金，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。

(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。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。
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) /持有期限 (N)	收费方式/费率
赎回费	N<7 天	1.50%
	7 天≤N<30 天	0.50%
	N≥30 天	0

注：本基金 C 类份额不收取申购费。

(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	0.80%	基金管理人和销售机构
托管费	0.15%	基金托管人
销售服务费	0.40%	销售机构
审计费用	30,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	120,000.00 元	规定披露报刊
指数许可使用费	0.015%	指数编制公司
其他费用	其他费用详见本基金招募说明书或其更新“基金的费用与税收”章节。	

注：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中扣除。上表中年费用金额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：

太平 MSCI 香港价值增强 C

	基金运作综合费率（年化）
持有期间	1.51%

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。

投资者投资本基金，将承受各种风险，因此在作出投资于本基金的决定之前，应慎重考虑面临市场风险、管理风险、职业道德风险、流动性风险、合规性风险、投资资产支持证券的风险、投资股指期货的风险及其他风险等。

指数化投资的特有风险

(1) 目标指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

目标指数并不能完全代表整个股票市场。目标指数成份股的平均回报率可能与整个股票市场的平均回报率存在偏离。

(2) 目标指数波动的风险

目标指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

(3) 基金投资组合回报与目标指数回报偏离及跟踪误差控制未达约定目标的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与目标指数的收益率发生偏离：

1) 由于目标指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪误差。

2) 由于目标指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在目标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误差。

3) 成份股派发现金红利、新股收益将导致基金收益率超过目标指数收益率，产生跟踪误差。

4) 由于成份股停牌、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误差。

5) 由于基金应对日常赎回保留的少量现金、投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费等费用的存在，使基金投资组合与目标指数产生跟踪误差。

6) 其他因素产生的跟踪误差。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票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) 目标指数变更的风险

尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更目标指数的情形，本基金将变更目标指数。基于原目标指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的风险收益特征将与新的目标指数保持一致，投资者必须承担此项调整带来的风险与成本。

(5) 指数编制机构停止服务的风险

(6) 成份股停牌或退市的风险

投资港股的特有风险

本基金除了投资于 A 股市场外，还可投资于法律法规规定范围内的香港联合交易所上市的股票，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、香港市场风险、市场制度以及交易规则不同等境外证券市场投资所面临的特有风险，包括但不限于：

(1) 汇率风险

在现行港股通机制下，港股的买卖是以港币报价，以人民币进行支付，并且资金不留港（港股交易后结算的净资金余额头寸以换汇的方式兑换为人民币），故本基金每日的港股买卖结算将进行相应的港币兑人民币的换汇操作，本基金承担港元对人民币汇率波动的风险，以及因汇率大幅波动引起账户透支的风险。另外本基金对港股买卖每日结算中所采用的报价汇率可能存在报价差异，本基金可能需额外承担买卖结算汇率报价点差所带来的损失；同时根据港股通的规则设定，本基金在每日买卖港股申请时将参考汇率买入/卖出价冻结相应的资金，该参考汇率买入价和卖出价设定上存在比例差异，以抵御该日汇率波动而带来的结算风险，本基金将因此而遭遇资金被额外占用进而降低基金投资效率的风险。

(2) 香港市场风险

与内地 A 股市场相比, 港股市场上外汇资金流动更为自由, 海外资金的流动对港股价格的影响巨大, 港股价格与海外资金流动表现出高度相关性, 本基金在参与港股市场投资时受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统风险相对更大。加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在, 港股股价受到意外事件影响可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动。

(3) 香港交易市场制度或规则不同带来的风险

香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则, 在“内地与香港股票市场交易互联互通机制”下参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险:

- 1) 港股市场实行 T+0 回转交易机制, 同时对个股不设涨跌幅限制, 因此每日涨跌幅空间相对较大;
- 2) 只有内地与香港均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日;

3) 香港出现台风、黑色暴雨或者香港联合交易所规定的其他情形时, 香港联合交易所将可能停市, 投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险; 出现内地证券交易所证券交易服务公司认定的交易异常情况时, 内地证券交易所证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务, 投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险;

- 4) 交收制度带来的基金流动性风险;
- 5) 香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险。

(4) 港股通制度限制或调整带来的风险

- 1) 港股通额度限制;
- 2) 港股通可投资标的范围调整带来的风险;
- 3) 港股通交易日设定的风险;
- 4) 港股通下对公司行为的处理规则带来的风险。

(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。

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.taipingfund.com.cn][客服电话 021-61560999、4000288699]

1. 基金合同、托管协议、招募说明书
2. 定期报告, 包括基金季度报告、中期报告和年度报告
3. 基金份额净值
4. 基金销售机构及联系方式
5. 其他重要资料