

摩根共同分类目录绿色债券债券型证券投资基金

A类 022617 C类 022618

全球视野 投资绿色中国

摩根共同分类目录绿色债券基金

国内首只《共同分类目录》主题绿色债券基金

11月18日起重磅首发

本单页提及的“国内首只《共同分类目录》主题绿色债券基金”是指万得数据显示，截至2024.10.31，本基金为国内市场唯一一只投资于符合共同分类目录标准的带有绿色标识的债券不低于非现金基金资产的90%的基金。本基金所定义的共同分类目录是指由中国人民银行和欧盟委员会共同发起编制的《可持续金融共同分类目录》及颁布机关对其不时做出的修订，以下简称《共同分类目录》。共同分类目录内列示了欧盟已采用的可持续金融分类方案和中国绿色金融目录共同认可的经济活动。本基金投资于债券资产不低于基金资产的80%，本基金投资于符合共同分类目录标准的带有绿色标识的债券不低于非现金基金资产的90%。具体投资范围和策略请参考《基金合同》、《招募说明书》和《基金产品资料概要》等法律文件。

1 多重政策利好，中国已成全球最大绿债发行市场

1. 政策支持

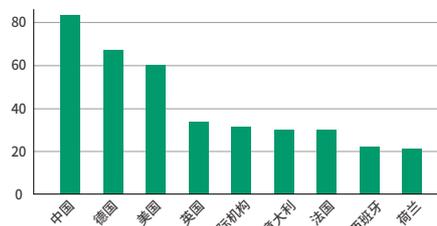
2023年10月中央金融工作会议指出做好绿色金融等“五篇大文章”，大力推进经济社会发展全面绿色转型。募集资金投向绿色经济活动，符合低碳环保趋势的绿色债券是国家战略的重要实践。



2. 全球最大

2023年中国在境内外市场发行了总额为9400亿元人民币（约1312.5亿美元）的贴标绿色债券。符合CBI绿色定义的绿色债券规模达835亿美元，已连续两年成为全球最大绿色债券发行市场*。

中国连续第二年成为全球最大绿色债券发行市场（十亿美元）



数据来源：气候债券倡议组织（CBI）和兴业经济研究咨询股份有限公司发布的《2023年中国可持续债券市场报告》。*统计口径为中国于境内外发行的符合气候倡议组织（CBI）绿色定义的绿色债券。

3. 国际接轨

为进一步扩大中国绿色金融市场的国际接轨，中国人民银行与欧盟委员会相关部门共同编制了《可持续金融共同分类目录》，为绿色债券市场带来了新的标准与机遇。

六大领域

中欧共同认可的
能源、制造、建筑、交通、固废和林业

+ 72项活动

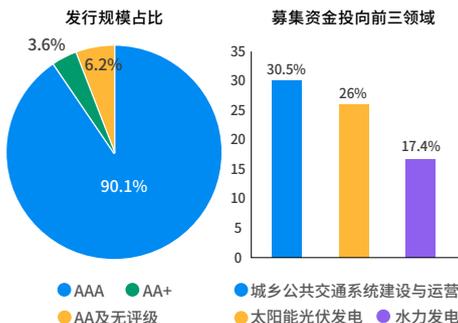
对减缓气候变化有重大贡献的
经济活动

数据来源：可持续金融国际平台官网《可持续金融共同分类目录》最新版，截至2022.6。

2 高评级、高标准、高性价比，捕捉绿债投资新机遇

1. 高评级，发行人AAA评级占比超90%

截至9月底，符合《共同分类目录》标准的中国绿色债券共348只，发行人以央国企等高级别机构为主。其中243只在存续期，发行规模3622.61亿元，主体评级AAA占比为90.1%。

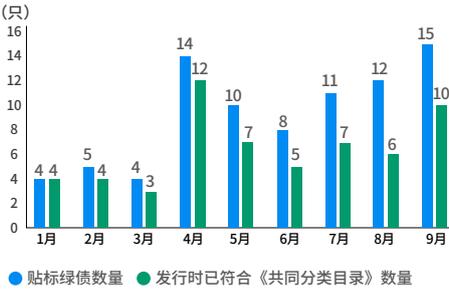


数据来源：中国外汇交易中心官网，符合《共同分类目录》标准的中国存量绿色债券清单2024年10月版，截至2024.9.30。

2. 高标准，“含绿量”备受认可

《共同分类目录》中的绿色债券符合中欧双重视可，“含绿量”品质过硬。绿色金融委员会专家组*每月会对银行间新发绿债贴标，今年共筛选83只绿色债券，符合《共同分类目录》标准的占58只。

银行间市场新发绿债的贴标情况



数据来源：中国外汇交易中心官网，统计区间2024年1月-9月。*中国金融学会绿色专业委员会专家组。

3. 高性价比，风险调整后回报更高

以CFETS共同分类目录绿色债券指数（总收益）为例，自基日以来年化回报3.27%，年化波动率0.49%，夏普比率3.66，与同期中债指数相比，风险调整后回报更高。

CFETS共同分类目录绿色债券指数（总收益）走势



数据来源：万得，CFETS共同分类目录绿色债券指数（总收益）的代码为CFXID00881.ID，基日2021.12.31，中债-总财富（总值）指数代码为CBA00301.CS，数据截至2024.10.31。指数的过往业绩并不预示其未来表现，也不构成对基金业绩表现的保证。

3 全球视野, 摩根资产管理深耕中国可持续投资

摩根资产管理中国依托全球化的研究资源和数据支持, 深耕中国本土投资, 为客户提供本地化可持续投资策略。本基金为国内首只《共同分类目录》主题绿色债券基金, 是中国绿色债券与国际化接轨的重要实践。

1. 摩根资产管理全球可持续投资团队



数据来源: 摩根资产管理, 截至2024.9.30。基金管理人及股东之间实行业务隔离制度, 股东并不直接参与基金财产的投资运作。

2. 全球视野的债券投研团队



数据来源: 摩根资产管理, 数据截至2024.9.30。基金管理人及股东之间实行业务隔离制度, 股东并不直接参与基金财产的投资运作。

3. 将信用债发行人ESG评价情况纳入投资参考



注: 环境、社会和公司治理又称为ESG, 所列ESG因素的示例仅供说明之用, 并未包含全部ESG因素, 且并非所有ESG因素均与某一特定债券投资有关。

产品要素

基金名称	摩根共同分类目录绿色债券债券型证券投资基金	基金简称	摩根共同分类目录绿色债券
基金类型	债券型基金	基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
基金管理人	摩根基金管理(中国)有限公司	基金经理	任翔
业绩比较基准	CFETS共同分类目录投资级主题绿色债券指数(全价)收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%		
投资目标	在合理充分的定量分析及定性研究基础上, 在风险可控的原则下, 通过参与债券类资产的投资运作, 力争获取超越基准的稳健回报。		
投资范围	<p>本基金主要投资于债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、国债期货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的相关规定)。</p> <p>本基金不投资于股票资产, 也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。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, 并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。</p> <p>本基金投资于债券资产不低于基金资产的80%, 本基金投资于符合共同分类目录标准的带有绿色标识的债券的比例不低于非现金基金资产的90%; 每个交易日日终, 在扣除国债期货合约需缴纳的保证金以后, 本基金应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会允许, 基金管理人在履行适当程序后, 可以调整上述投资品种的投资比例。</p>		
风险收益特征	本基金为债券型基金, 其预期风险与预期收益高于货币市场基金, 低于混合型基金和股票型基金。		

费率结构

认/申购费率 (仅针对A类份额, C类份额不收取认/申购费用)

认/申购区间	认购费率	申购费率
人民币100万元以下	0.60%	0.8%
人民币100万元以上(含), 300万元以下	0.40%	0.5%
人民币300万元以上(含), 500万元以下	0.20%	0.3%
人民币500万元以上(含)	1000元/笔	1000元/笔

赎回费率 (A/C类)

持有期限	赎回费率
7日以内(不含)	1.5%
7日以上(含)	0%

销售服务费 (仅针对C类份额) 按前一日C类基金份额资产净值的0.10%年费率计提

最低认/申购额	人民币1元	管理费	0.3%每年	托管费	0.10%每年
---------	-------	-----	--------	-----	---------

注: 具体产品要素和费率结构请参考《基金合同》、《招募说明书》和《基金产品资料概要》等法律文件。

风险提示: 投资有风险, 投资需谨慎。公开募集证券投资基金(以下简称“基金”)是一种长期投资工具, 其主要功能是分散投资, 降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄等能够提供固定收益预期的金融工具, 当您购买基金产品时, 既可能按持有份额分享基金投资所产生的收益, 也可能承担基金投资所带来的损失。您在做出投资决策之前, 请仔细阅读基金合同、基金招募说明书和基金产品资料概要等法律文件, 充分认识本基金的风险收益特征和产品特性, 认真考虑本基金存在的各项风险因素, 并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等因素充分考虑自身的风险承受能力, 在了解产品情况及销售适当性意见的基础上, 理性判断并谨慎做出投资决策。根据有关法律法规, 摩根基金管理(中国)有限公司做出如下风险提示: 一、依据投资对象的不同基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金、基金中基金、商品基金等不同类型, 您投资不同类型的基金将获得不同的收益预期, 也将承担不同程度的风险。一般来说, 基金的收益预期越高, 您承担的风险也越大。二、基金在投资运作过程中可能面临各种风险, 既包括市场风险, 也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险, 即当单个开放日基金的净赎回申请超过基金总份额的一定比例(开放式基金为百分之十, 定期开放基金为百分之二十, 中国证监会规定的特殊产品除外)时, 您可能无法及时赎回申请的全部基金份额, 或您赎回的款项可能延缓支付。三、您应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的差别。定期定额投资是引导投资者进行长期投资、平均投资成本的一种简单可行的投资方式, 并不能规避基金投资所固有的风险, 不能保证投资者获得收益, 也不是替代储蓄的等效理财方式。四、特殊类型产品风险提示: 本基金可参与资产支持证券的投资, 存在因投资资产支持证券而带来的风险, 包括价格波动风险、流动性风险、信用风险等。本基金可参与国债期货的投资, 国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险等。本基金合同生效后, 如连续50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, 基金合同终止, 且不需召开基金份额持有人大会。故基金份额持有人可能面临基金合同自动终止的不确定性风险。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时, 基金管理人履行相应程序后, 可以启动侧袋机制, 具体详见基金合同和招募说明书的相关章节。侧袋机制实施期间, 基金管理人将对基金简称进行特殊标识, 并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。有关可投资资产的风险, 本基金在挑选债券时采用具有约束力的标准, 投资于符合共同分类目录标准的带有绿色标识的债券的比例不低于非现金基金资产的90%。基金的投资组合集中于绿色债券, 因此可能会比投资于更分散的投资组合的波动更大。本基金也可根据特定价值或规范排除债券。与不采用有关准则的类似基金相比, 将ESG系统性地纳入投资分析并对投资决策产生约束力, 可能对基金的表现构成不利影响。此外, 如采用排除法也可能导致基金错失具有吸引力的投资机会或可能在不利时机根据ESG标准卖出债券。法律法规及行业规范不断发展, 可能会影响较多债券的可持续性, 尤其是在环境及社会因素方面。该等措施的任何更改均可能对有关债券造成不利影响, 进而可能令其无法成为基金的可投资标的(尽管其具有商业吸引力)。ESG评估方法缺乏标准化的分类法, 而采用ESG评估的不同基金运用有关研究过程的方式可能会有所不同。对公司进行ESG评估可能需要主观判断, 其中可能包括考虑第三方数据, 而该类数据可能主观、不完整或不准确, 并可能影响投资者衡量及评估潜在投资的环境及社会影响的能力和可能导致基金投资于ESG表现较弱的债券。无法保证管理人将正确评估对基金投资造成的ESG影响。本基金风险收益特征会定期评估并在公司网站发布, 请投资者关注。投资本基金的具体风险请见《招募说明书》的“风险提示”章节。五、基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 但不保证本基金一定盈利, 也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现, 基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。摩根基金管理(中国)有限公司提醒您基金投资的“买者自负”原则, 在做出投资决策后, 基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险, 由您自行承担。基金管理人、基金托管人、基金销售机构及相关机构不对基金投资收益做出任何承诺或保证。六、摩根共同分类目录绿色债券债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)由摩根基金管理(中国)有限公司(以下简称“基金管理人”)依照有关法律法规及约定申请募集, 并经中国证监会(以下简称“中国证监会”)许可注册。本基金的基金合同、基金招募说明书和基金产品资料概要已通过中国证监会基金电子披露网站http://eid.csrc.gov.cn/fund和基金管理人网站 www.cifm.com进行公开披露。中国证监会对本基金的注册, 并不表明其对本基金的投资价值、市场前景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。

上投摩根基金管理公司于2023年4月正式更名为摩根基金管理(中国)有限公司。摩根基金管理(中国)有限公司在中国内地使用「摩根资产管理」及「J.P. Morgan Asset Management」作为对外品牌名称, 与JPMorgan Chase & Co.集团及其全球联营公司旗下资产管理业务的品牌名称保持一致。摩根基金管理(中国)有限公司与股东之间实行业务隔离制度, 股东并不直接参与基金财产的投资运作。

风险提示: 投资有风险, 在进行投资前请仔细阅读相关基金的《基金合同》、《招募说明书》和《基金产品资料概要》等法律文件。本资料仅为公开宣传材料, 不作为任何法律文件。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责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, 同时基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。上述资料并不构成投资建议, 或发售或邀请认购任何证券、投资产品或服务。所刊载资料均来自被认可的可靠信息来源, 但仍请自行核实有关资料。观点和预测仅代表当时观点, 今后可能发生改变。本产品由摩根基金管理(中国)有限公司发行与管理, 代销机构不承担产品的投资、兑付和风险管理责任。本基金募集期内的最高募集规模为60亿元人民币(不包括募集期利息), 如超过本基金管理人将采用末日比例确认的方式实现募集规模的有效控制(详情参阅基金发售公告)。