

嘉实中证央企创新驱动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：2020年8月27日

送出日期：2020年8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	嘉实央企创新驱动ETF	基金代码	515680
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	基金托管人	中国银行股份有限公司
基金合同生效日	2019年9月20日	上市交易所及上市日期	上海证券交易所 2019年12月18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	金猛	开始担任本基金基金经理的日期	2019年9月20日
		证券从业日期	2012年2月1日
基金经理	刘珈吟	开始担任本基金基金经理的日期	2019年9月20日
		证券从业日期	2009年6月1日
其他	《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60个工作日出现前述情形的，基金管理人经与基金托管人协商一致，可对本基金进行清算，终止本《基金合同》，无需召开基金份额持有人大会进行表决。		

注：场内简称：创新央企；扩位场内简称：嘉实央企创新ETF。

二、基金投资与净值表现

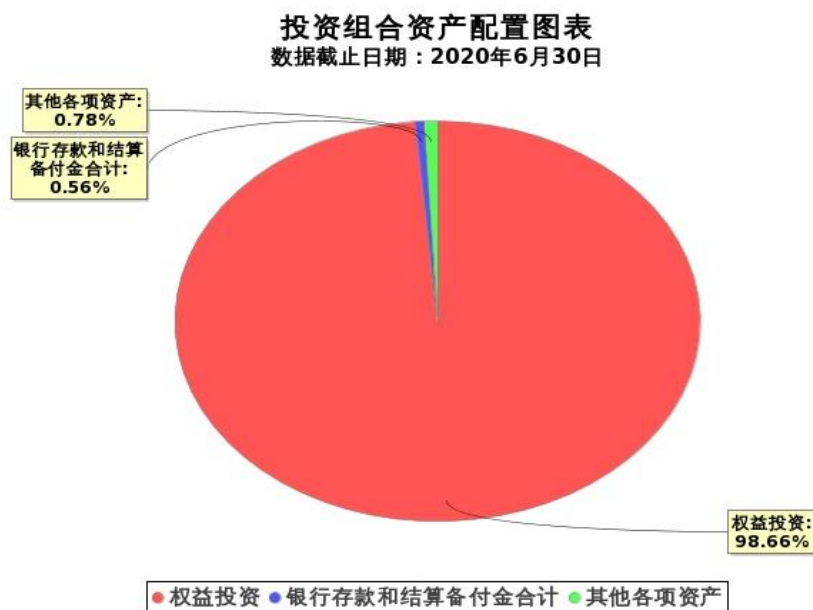
(一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。
投资范围	本基金的投资范围主要为标的指数（中证央企创新驱动指数）成份股及备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、衍生工具（股指期货、股票期权等）、债券资产（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金资产以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）。本基金可根据相关法律法规和基金合

	同的约定，参与融资业务和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。本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例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。每个交易日日终，在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金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、股票期权及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。
主要投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组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。但因特殊情况（如流动性原因等）导致无法完全投资于标的指数成分股时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。其他投资策略包括金融衍生品投资策略、融资及转融通证券出借、资产支持证券投资策略等。
业绩比较基准	中证央企创新驱动指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型证券投资基金，预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要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。

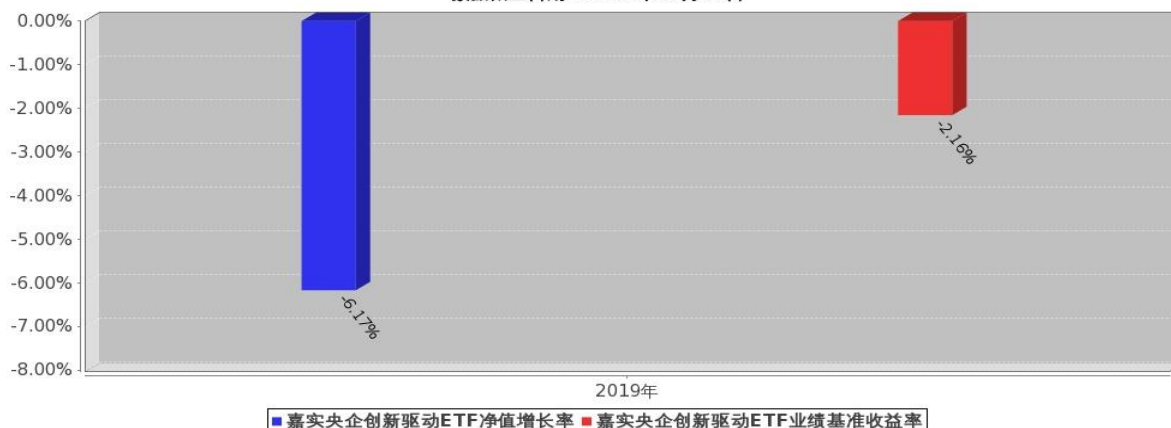
注：详见《嘉实中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》第十部分“基金的投资”。

(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/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

嘉实央企创新驱动ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图
数据截止日期：2019年12月31日



注：基金的过往业绩不代表未来表现；基金合同生效当年的相关数据根据当年实际存续期计算。

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：

注：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；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(%)
管理费	0.150
指数许可使用费 (E ≤ 100 亿元)	$E \times 0.03\% / \text{当年天数}$
指数许可使用费 (E > 100 亿元)	$[100 \times 0.03\% + (E - 100) \times 0.02\%] / \text{当年天数}$
托管费	0.050
销售服务费	-
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用，《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼或仲裁费，基金份额持有人大会费用，因基金的证券、期货交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金及其他类似性质的费用等），基金的银行汇划费用，基金的开户费用、账户维护费用，基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议约定的指数许可使用费，基金的上市初费和年费，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其他费用。

注：E 为前一日的基金资产净值，许可使用基点费的收取下限为每季度人民币 50,000 元（大写：伍万圆）。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。

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。

一) 本基金特有的风险：1、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险：标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离；2、标的指数波动的风险：标的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标的指数回报偏离的风险。

二) 基金管理过程中共有的风险：市场风险、信用风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险、投资于股指期货的特定风险、投资于股票期权的特定风险、基金自动终止风险以及其他风险。

(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。

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

以下资料详见嘉实基金管理有限公司官方网站：www.jsfund.cn；客服电话：400-600-8800。

- 1、《嘉实中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
《嘉实中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
《嘉实中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 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