

嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金(A类份额)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	嘉实中证金边中期国债ETF联接	基金代码	000087	
分级基金简称	嘉实中证金边中期国债ETF联接A	分级基金交易代码	000087	
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	2013年5月10日	上市交易所及上市日期	-	-
基金类型	债券型	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	王亚洲	开始担任本基金基金经理的日期	2015年7月9日	
		证券从业日期	2012年6月1日	

二、基金投资与净值表现

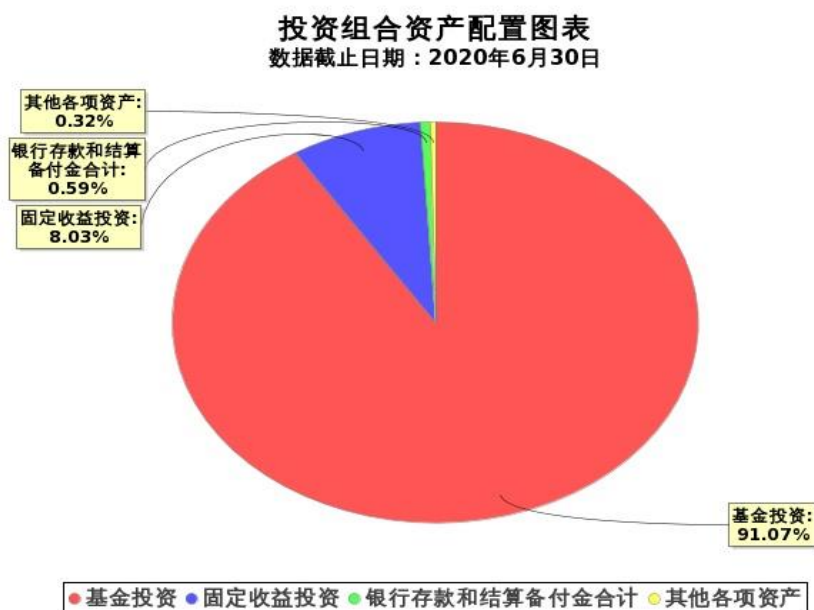
(一) 投资目标与投资策略

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，力争本基金的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0.3%，年跟踪误差不超过4%。
投资范围	本基金的目标ETF为嘉实中证金边中期国债ETF，目标ETF的标的指数为中证金边中期国债指数。本基金以目标ETF基金份额，标的指数成份券及备选成份券为主要投资对象。本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内），持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例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。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于衍生工具（国债期货）、其他债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、中小企业私募债、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、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）。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。
主要投资策略	在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。本基金还将适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回的组合套利，以增强基金收益。

业绩比较基准	中证金边中期国债指数*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为嘉实中期国债ETF的联接基金，主要通过投资于嘉实中期国债ETF来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与中证金边中期国债指数及嘉实中期国债ETF的表现密切相关。本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

注：详见《嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》第十二部分“基金的投资”。

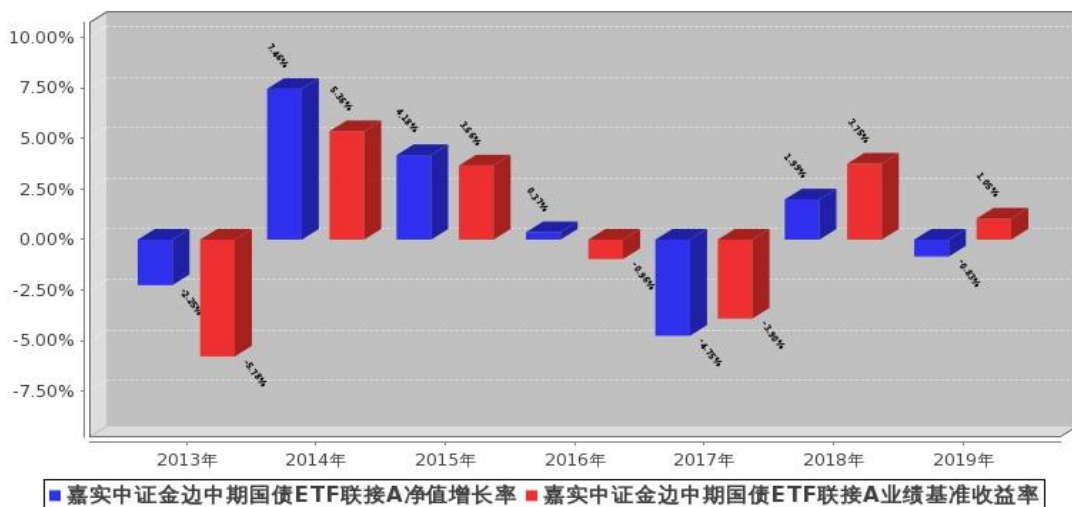
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表



(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

嘉实中证金边中期国债ETF联接A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：

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)	$M < 500,000.00$	0.500%
	$500,000.00 \leq M < 1,000,000.00$	0.400%
	$1,000,000.00 \leq M < 2,000,000.00$	0.300%
	$2,000,000.00 \leq M < 5,000,000.00$	0.200%
	$5,000,000.00 \leq M$	1,000.000 元/笔
赎回费	$N < 7$ 天	1.500%
	$7 \leq N < 365$ 天	0.100%
	$365 \leq N < 730$ 天	0.050%
	$730 \leq N$ 天	0.000%

(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	0.300
托管费	0.100
销售服务费	-
其他费用	因基金的证券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、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等），基金合同生效以后的信息披露费用，基金份额持有人大会费用，基金合同生效以后的会计师费和律师费，基金资产的资金汇划费用，按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用

	用。
--	----

注:本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费。在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取0)的0.3%年费率计提。本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取0)的0.1%年费率计提。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

由于本基金为目标ETF的联接基金,主要通过投资于目标ETF来力求获得与目标ETF所跟踪的标的指数相近的平均收益率,因此目标ETF的特有风险也是本基金的特定风险。简要说明如下,具体情况可参见目标ETF招募说明书:

- 1、标的指数回报与债券市场平均回报偏离的风险
- 2、标的指数波动的风险
- 3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险
- 4、标的指数变更的风险
- 5、其他投资于目标ETF的风险

二) 基金管理过程中共有的风险如市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险和其他风险。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的核准,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、《嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》
《嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》
《嘉实中证金边中期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》
- 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