

嘉实中证金融地产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：2021年3月29日

送出日期：2021年3月31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 | 嘉实中证金融地产ETF联接 | 基金代码 | 001539 |
| 下属基金简称 | 嘉实中证金融地产ETF联接A | 下属基金交易代码 | 001539 |
| 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 | 2015年8月6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 | 李直 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2019年9月28日 |
| | | 证券从业日期 | 2014年7月1日 |
| 基金经理 | 刘珈吟 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2016年3月24日 |
| | | 证券从业日期 | 2009年6月1日 |

二、基金投资与净值表现

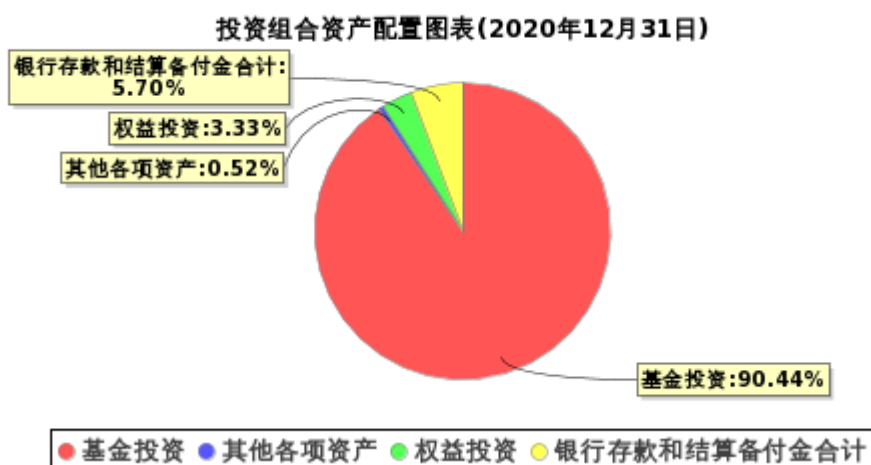
(一) 投资目标与投资策略

详见《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》第十部分“基金的投资”。

| | |
|------|--|
| 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，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。 |
| 投资范围 | <p>本基金以目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。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）；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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的股票）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、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）。</p> <p>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。</p> |

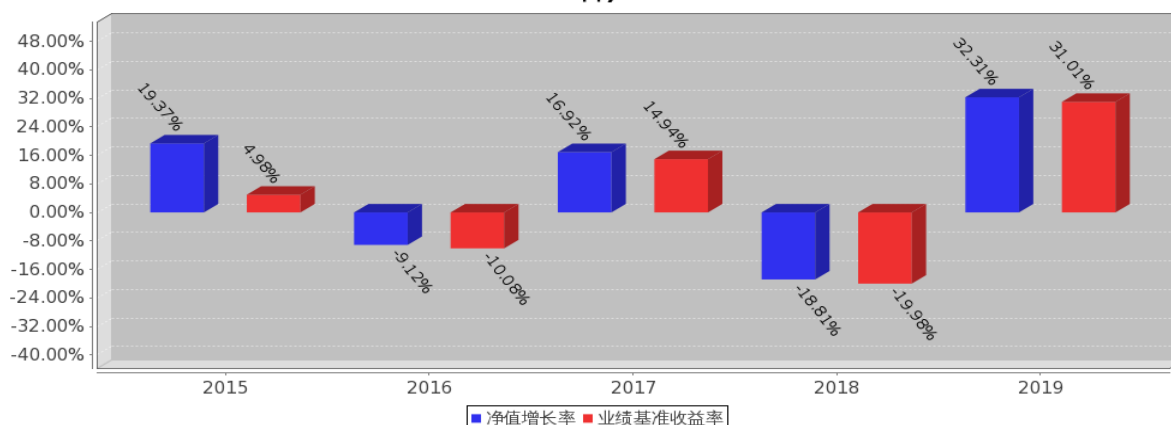
| | |
|---------------|--|
| | 本基金的标的指数为中证指数有限公司编制并发布的中证金融地产指数，及其未来可能发生的变更。 |
| 主要投资策略 | <p>本基金为目标ETF的联接基金。主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。</p> <p>在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。本基金还将适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回的组合套利，以增强基金收益。</p> <p>此外，为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。</p> <p>股指期货投资策略：本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>权证投资策略：权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制风险、实现保值和锁定收益。</p> <p>资产支持证券投资策略：本基金综合考虑市场利率、发行条款支持资产的构成及质量等因素，主要从资产池信用状况、违约相关性历史记录和损失比例证券的增强方从资产池信用状况、违约相关性历史记录和损失比例证券的增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券的风险与收益状况进行评估，在严格控制风险的情况下，确定资产合理配置比例，在保证资产安全性的前提条件下，以期获得长期稳定收益。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证金融地产指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5% |
| 风险收益特征 | 本基金为嘉实中证金融地产ETF的联接基金，主要通过投资于嘉实中证金融地产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融地产指数及嘉实中证金融地产ETF的表现密切相关。本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 |

(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

嘉实中证金融地产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(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) | $M < 500,000$ | 1.2% |
| | $500,000 \leq M < 2,000,000$ | 0.8% |
| | $2,000,000 \leq M < 5,000,000$ | 0.4% |
| | $5,000,000 \leq M$ | 1,000.0000 元/笔 |
| 申购费 (后收费) | $N < 1$ 年 | 0.2% |
| | $1 \text{ 年} \leq N < 3 \text{ 年}$ | 0.1% |
| | $N \geq 3$ 年 | 0% |
| 赎回费 | $N < 7$ 天 | 1.5% |
| | $7 \text{ 天} \leq N < 365 \text{ 天}$ | 0.5% |
| | $365 \text{ 天} \leq N < 730 \text{ 天}$ | 0.25% |
| | $N \geq 730$ 天 | 0% |

(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 | 0.5% |
| 托管费 | 0.1% |
| 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事务所费、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);基金的开户费用、账户维护费用;基金上市初费和月费(如上市);基金的银行汇划费用;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:本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费;本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费。

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
- 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、指数编制机构停止服务的风险
- 6、成份股停牌的风险
- 7、其他投资于目标ETF的风险

二) 基金管理过程中共有的风险:

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、投资于股指期货的特定风险以及其他风险。

(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、《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》
《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》
《嘉实中证金融地产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

六、其他情况说明

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定,本次基金产品资料概要更新了“产品概况”中的“投资组合资产配置图表”信息,以及“风险揭示”部分。