

关于嘉实中证新兴科技 100 策略交易型开放式指数证券投资基金标的指数纳入北京证券交易所股票并修订招募说明书的公告

根据中证指数有限公司相关指数成份股的定期调整情况,嘉实基金管理有限公司(以下简称“本公司”)旗下嘉实中证新兴科技 100 策略交易型开放式指数证券投资基金(基金代码:515860;扩位证券简称:科技 ETF 嘉实;场内简称:科技 100;以下简称“本基金”)标的指数纳入北京证券交易所股票。为更好地满足基金运作需求,根据相关业务规则、法律法规、基金合同等有关规定,本公司决定自 2025 年 9 月 15 日起对本基金的招募说明书进行修订,此次修订主要涉及调整申购与赎回章节中现金替代的相关内容,明确北京证券交易所上市成份证券现金替代相关规则,并相应补充基金投资北京证券交易所股票的相关风险提示。

本次修订涉及的相关规则自 2025 年 9 月 15 日起生效。本次修订事项对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响,并已履行了相应的程序。基金管理人
对招募说明书的修订请参考附件。

本公告仅对招募说明书修订的有关事项进行说明,招募说明书、基金产品资料概要中涉及的调整内容将进行相应更新。客户欲了解详细情况,请仔细阅读刊登于本基金管理人网站(www.jsfund.cn)及中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)的招募说明书、基金产品资料概要等文件及其更新,以及相关业务公告。

投资者可以登录本公司网站（www.jsfund.cn）或拨打客户服务电话（400-600-8800）咨询相关信息。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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。敬请投资人注意投资风险。投资人投资于上述基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书和基金产品资料概要及其更新等法律文件。

特此公告。

嘉实基金管理有限公司

2025年9月12日

附件：“嘉实中证新兴科技 100 策略交易型开放式指数证券投资基金”《招

募说明书》修订内容对照表

章节	原表述	修改后
重要提示		<p>新增：</p> <p><u>本基金可投资于北京证券交易所股票，北京证券交易所主要服务于创新型中小企业，在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异，投资者投资于本基金可能面临的风险包括但不限于上市公司经营风险、股价大幅波动风险、退市风险、流动性风险、转板风险、系统性风险等。</u></p>
九、基金份额的申购、赎回	<p>(五) 申购与赎回的程序</p> <p>3、申购和赎回的清算交收与登记</p> <p>对于本基金的申购、赎回业务采用净额结算的方式，即基金份额、上交所上市的成份股的现金替代、深交所上市的成份股的现金替代采用净额结算的方式；申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。</p> <p>(七) 申购赎回清单的内容与格式</p>	<p>(五) 申购与赎回的程序</p> <p>3、申购和赎回的清算交收与登记</p> <p>对于本基金的申购、赎回业务采用净额结算的方式，即基金份额、上交所上市的成份股的现金替代、<u>深交所上市的成份股的现金替代</u>、<u>北交所上市的成份股的现金替代</u>采用净额结算的方式；申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。</p> <p>(七) 申购赎回清单的内容与格式</p>

<p>3、现金替代相关内容</p> <p>(1) 现金替代分为 4 种类型：……</p> <p>退补现金替代适用于深交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。</p> <p>(4) 退补现金替代</p> <p>①适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于本基金标的指数中深交所股票。</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在深交所连续竞价期间，根据收到的上交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深交所申报被替代证券的交易指令。</p> <p>……</p> <p>特例情况：若自T日起，深圳证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应</p>	<p>3、现金替代相关内容</p> <p>(1) 现金替代分为 4 种类型：……</p> <p>退补现金替代适用于深交所、<u>北交所</u>上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。</p> <p>(4) 退补现金替代</p> <p>①适用情形：退补现金替代的证券目前适用于本基金标的指数中深交所、<u>北交所</u>股票。</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在深交所、<u>北交所</u>连续竞价期间，根据收到的上交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深交所、<u>北交所</u>申报被替代证券的交易指令。</p> <p>……</p> <p>特例情况：若自 T 日起，深圳证券交易所、<u>北京证券交易所</u>正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代</p>
--	--

	<p>退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p>	<p>证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p> <p><u>指数成份股包含北交所上市成份股的，可参照深交所上市的成份股规则进行处理，具体参照交易所及登记结算机构发布的最新规则。</u></p>
<p>十八、 风险 揭示</p>		<p>（六）本基金特有的风险</p> <p><u>新增：</u></p> <p><u>17、投资于北交所股票的风险</u></p> <p><u>北京证券交易所主要服务于创新型中小企业，在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异，基金投资北交所股票的风险包括但不限于：</u></p> <p><u>1) 上市公司经营风险</u></p> <p><u>由于北京证券交易所上市的企业大部分为创新型中小企业，其在持续经营能力、核心技术、管理团队稳定性、财务数据稳定性及企业应对外部政策、市场等</u></p>

方面具有较大的不确定性，由此可能导致投资北京证券交易所上市股票对基金净值产生不利影响。

2) 股价大幅波动风险

北京证券交易所在证券发行、交易、投资者适当性等方面与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所设置了更宽的涨跌幅限制（上市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%），可能导致较大的股票价格波动。

3) 退市风险

北京证券交易所上市公司可能会触及北京证券交易所规定的退市情形，导致其股票存在被终止上市风险，给基金净值带来不利影响。

4) 流动性风险

北京证券交易所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，由此可能导致基金面临无法及时变现及其

他相关流动性风险。

5) 转板风险

北京证券交易所上市公司在满足相关法律法规和证监会规定的基本上市条件并符合交易所规定的具体上市条件的，可申请转板上市。无论北交所上市公司是否转板成功，均可能引起基金净值波动。

6) 系统性风险

北京证券交易所上市公司主要属于创新成长型企业，其商业模式、盈利、风险和业绩波动等特征较为相似，因此基金难以通过分散投资来降低风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值较大波动。