

嘉实中证金边中期国债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	嘉实中证中期国债 ETF	基金代码	159926	
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	深圳证券交易所	2013年8月 5日
基金类型	债券型	交易币种	人民币	
运作方式	交易型开放式	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	

注：本基金场内简称为国债 ETF。

二、基金投资与净值表现

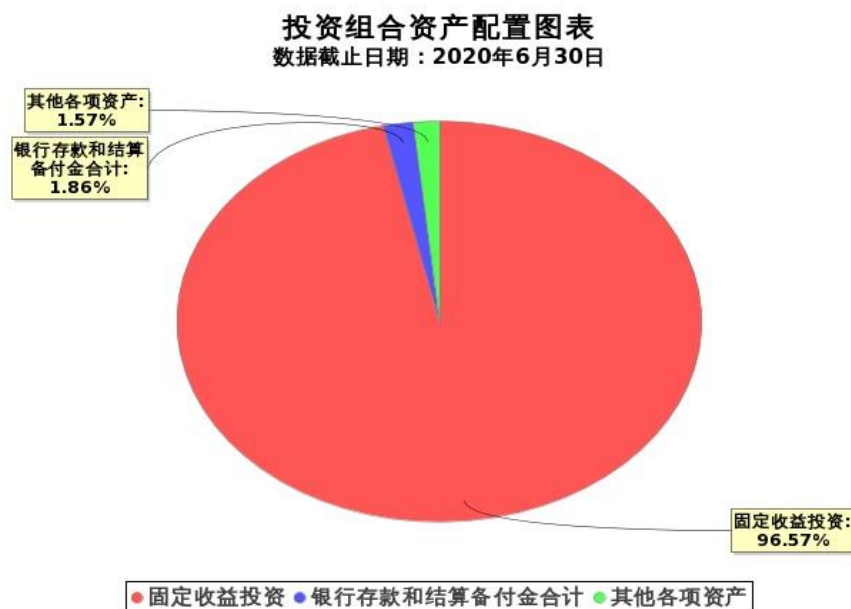
(一) 投资目标与投资策略

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，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 0.25%，年跟踪误差不超过 3%。
投资范围	本基金标的指数为中证金边中期国债指数。 本基金投资范围主要为标的指数成份券和备选成份券。本基金将把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现，正常情况下投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于基金资产净值的 80%。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	本基金主要采用代表性分层抽样复制策略，投资于标的指数中具有代表性的成份券及备选成份券，或选择非成份券作为替代，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所和银行间债券交易特性及交易惯例等情况，通过“久期匹配”、“信用等级匹配”、“期限匹配”等优化策略对基金资产进行抽样化调整，降低交易成本，以期在规定的风险承受限度之内，尽量控制跟踪误差最小化。由于采用抽样复制法，同时结合本基金资产规模、日常申购赎回情

	况、市场流动性、债券交易特性及交易惯例等因素的影响，本基金组合中个券只数、权重和券种与标的指数成份券个数、权重和券种间将存在差异。此外，本基金还将积极参与风险低且可控的债券回购等投资，以弥补基金费用、增加基金收益。 1、资产配置策略 2、债券投资策略 3、衍生品投资 4、其他品种
业绩比较基准	中证金边中期国债指数
风险收益特征	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型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用代表性分层抽样复制策略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债券市场相似的风险收益特征

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招募说明书》第十一部分“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

嘉实中证中期国债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,申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额 0.5%的标准收取佣金,其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

(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
基金合同生效后的指数许可使用费	0.020
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),基金合同生效后的信息披露费用,基金上市费及年费,基金份额持有人大会费用,基金合同生效后的会计师费和律师费,基金资产的资金汇划费用,按照法律法规和基金合同规定可以列入的其他费用。

注: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。

根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定,标的指数许可使用费的收取下限为每季(自然季度)人民币25,000元,计费区间不足一季度的,以一季度计算。

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、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险
- 6、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险
- 7、退市风险
- 8、投资者申购失败的风险
- 9、投资者赎回失败的风险
- 10、基金份额赎回对价的变现风险
- 11、第三方机构服务的风险

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