

嘉实中证 A100 指数增强型发起式证券投资基金（A 类份额）

基金产品资料概要更新

编制日期：2025 年 6 月 6 日

送出日期：2025 年 6 月 10 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 A100 指数增强发起式                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | 基金代码           | 021799          |
| 下属基金简称  | 嘉实中证 A100 指数增强发起式 A                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 下属基金交易代码       | 021799          |
| 基金管理人   | 嘉实基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 基金托管人          | 招商银行股份有限公司      |
| 基金合同生效日 | 2024 年 12 月 24 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    | 龙昌伦                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2025 年 2 月 24 日 |
|         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 证券从业日期         | 2013 年 7 月 1 日  |
| 其他      | 基金合同生效之日起三年后的对应日（指自然日），若基金资产净值低于两亿元的，基金合同自动终止，无需召开基金份额持有人大会审议决定，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。若届时法律法规或监管部门规定发生变化，上述终止规定被取消或更改的，则本基金可以参照届时有效的法律法规或监管部门的规定执行。<br>基金合同生效三年后本基金继续存续的，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 50 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，终止基金合同，无需召开基金份额持有人大会进行表决。 |                |                 |

二、基金投资与净值表现

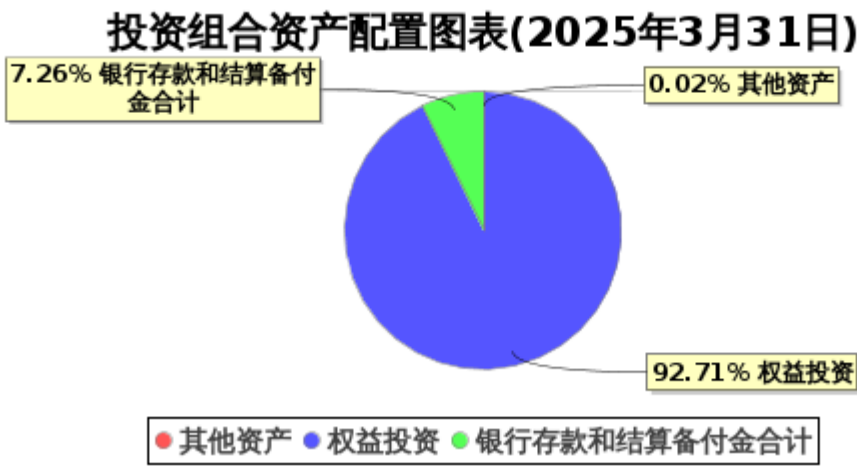
（一）投资目标与投资策略

详见《嘉实中证 A100 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》“九、基金的投资”。

|      |                                                                                                                                             |
|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金为增强型指数基金，力求对标的指数（中证 A100 指数）进行有效跟踪的基础上，通过精选个股策略增强并优化指数组合管理和风险控制，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。 |
| 投资范围 | 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证），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（包含主板、创业板、科创板、存托凭证及其他依法发行上市的股票）、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次                          |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、股票期权、现金以及法律法规或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>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。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%；投资于中证 A100 指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；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。</p> <p>如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金采用指数增强型投资策略，以中证 A100 指数作为基金投资组合的标的指数。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。</p> <p>具体投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借业务策略。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 业绩比较基准 | 中证 A100 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 风险收益特征 | 本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为指数型基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方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证券市场相似的风险收益特征。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

(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基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

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）<br>/持有期限（N）        | 收费方式/费率   |
|--------------|--------------------------------|-----------|
| 申购费<br>（前收费） | $M < 1,000,000$                | 1%        |
|              | $1,000,000 \leq M < 2,000,000$ | 0.6%      |
|              | $2,000,000 \leq M < 5,000,000$ | 0.2%      |
|              | $M \geq 5,000,000$             | 1,000 元/笔 |
| 赎回费          | $N < 7$ 天                      | 1.5%      |
|              | $7 \text{ 天} \leq N < 30$ 天    | 0.75%     |
|              | $30 \text{ 天} \leq N < 180$ 天  | 0.5%      |
|              | $N \geq 180$ 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/年费率或金额                                                                                     | 收取方        |
|-------|-------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|
| 管理费   | 0.8%                                                                                            | 基金管理人、销售机构 |
| 托管费   | 0.2%                                                                                            | 基金托管人      |
| 审计费用  | 5,000.00 元                                                                                      | 会计师事务所     |
| 信息披露费 | 120,000.00 元                                                                                    | 规定披露报刊     |
| 其他费用  | 基金合同生效后与基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用等可以在基金财产中列支的其他费用，按照国家有关规定和《基金合同》约定在基金财产中列支。费用类别详见本基金基金合同及招募说明书或其更新。 |            |

注：1、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。

2、审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准。

## （三）基金运作综合费用测算

## 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、包括主动增强投资的风险
- 2、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险
- 3、标的指数波动的风险
- 4、跟踪误差控制未达约定目标或基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险
- 5、指数编制机构停止服务的风险
- 6、成份股停牌的风险
- 7、可投资于股指期货
- 8、股票期权等金融衍生品的风险
- 9、融资及转融通证券出借的风险

- 10、投资资产支持证券的风险
- 11、投资存托凭证的风险
- 12、科创板投资风险
- 13、发起式基金的风险及基金合同自动终止风险

## 二）基金管理过程中共有的风险

包括市场风险、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

中国证监会对嘉实中证 A100 指数增强型发起式证券投资基金募集的注册，并不表明其对嘉实中证 A100 指数增强型发起式证券投资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，基金管理人至少每年更新一次。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](http://www.jsfund.cn)；客服电话：400-600-8800。

- 1、《嘉实中证 A100 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 《嘉实中证 A100 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 《嘉实中证 A100 指数增强型发起式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