嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）(A 类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2021 年 9 月 27 日

送出日期：2021 年 9 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	嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)	**基金代码**	160706	
下属基金简称	嘉实沪深 300ETF 联接(LOF)A	**下属基金交易代码**	160706	
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	2005 年 8 月 29 日	**上市交易所及上市日期**	深圳证券交易所	2005 年 10 月 17 日
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	何如	**开始担任本基金基金经理的日期**	2016 年 1 月 5 日	
		证券从业日期	2006 年 3 月 1 日	
基金经理	刘珈吟	**开始担任本基金基金经理的日期**	2021 年 9 月 24 日	
		证券从业日期	2009 年 6 月 1 日	

注:本基金场内简称：沪深 300LOF。

二、基金投资与净值表现

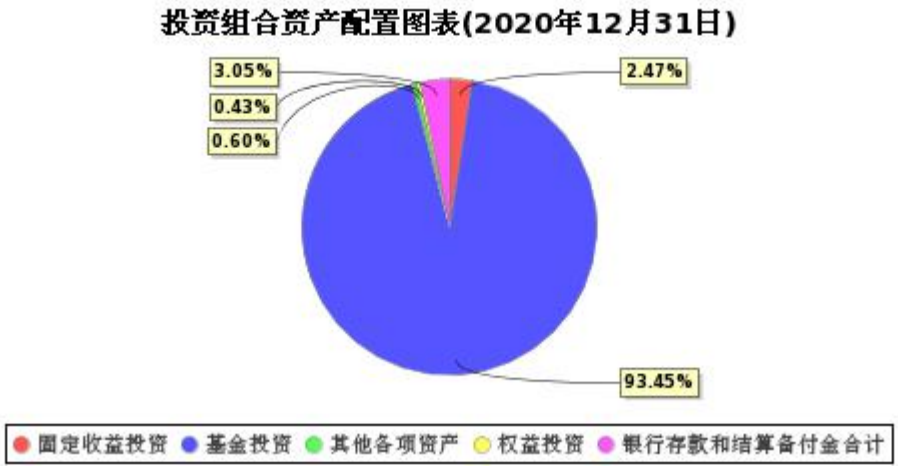
(一) 投资目标与投资策略

详见《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）招募说明书》第十一部分“基金的投资”。

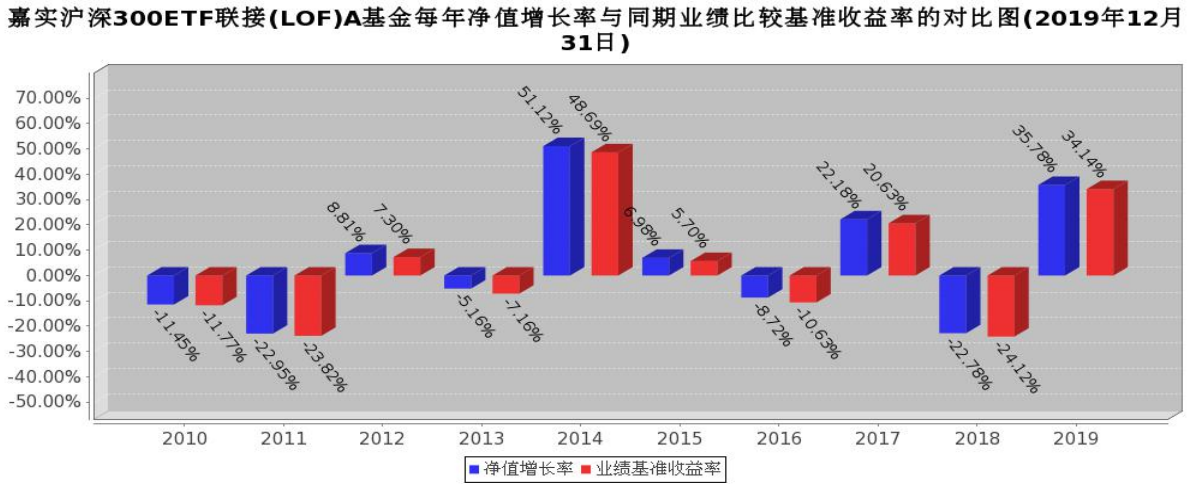
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%，以实现对沪深 300 指数的有效跟踪，谋求通过中国证券市场来分享中国经济持续、稳定、快速发展的成果。
投资范围	本基金以目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%（已申购但尚未确认的目标 ETF 份额可计入在内），持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，为更好地实现投资目标，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）、一级市场新股或增发的股票、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、分离交易可转债、央

	行票据、中期票据、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。 本基金的标的指数为中证指数有限公司编制并发布的沪深 300 指数，及其未来可能发生的变更。
主要投资策略	本基金为目标 ETF 的联接基金。主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，在正常市场情况下，本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%。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。 资产配置比例：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 。本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。 组合构建：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。 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，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。
业绩比较基准	95%的沪深 300 指数增长率加 5%的银行活期存款税后利率
风险收益特征	风险中等，获得证券市场平均收益率。

(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



注:基金的过往业绩不代表未来表现。

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	备注
申购费（前收费）	M<500,000	1.5%	-
	500,000≤M<2,000,000	1.2%	-
	2,000,000≤M<5,000,000	1%	-
	M≥5,000,000	1,000 元/笔	-
申购费（后收费）	N<1 年	0.2%	-
	1 年≤N<3 年	0.1%	-
	N≥3 年	0%	-
赎回费	N<7 天	1.5%	场外
	7 天≤N<365 天	0.5%	场外
	365 天≤N<730 天	0.25%	场外
	N≥730 天	0%	场外
	N<7 天	1.5%	场内
	N≥7 天	0.5%	场内

注:通过本公司直销中心申购本基金 A 类份额的养老金客户实施特定申购费率，适用的申购费率为对应申购金额所适用的原申购费率的 10%；申购费率为固定金额的，则按原费率执行，不再享有费率折扣。详见本基金《招募说明书》及相关公告。

场内交易费用以证券公司实际收取为准。

(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	证券交易费用；基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；基金份额持有人大会费用；基金合同生效后与基金相关的会计师费和律师费；按照国家有关规定可以列入的其他费用。

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、基金份额价格与份额净值发生偏离的风险

5、标的指数变更的风险

6、指数编制机构停止服务的风险

7、成份股停牌的风险

8、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、合规性风险以及其他风险。

(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、《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同》

《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）托管协议》

《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）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基金经理信息。