

嘉实中证 AAA 科技创新公司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：2026 年 6 月 9 日

送出日期：2026 年 6 月 11 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 AAA 科技创新公司债 ETF	基金代码	159600
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金合同生效日	2025 年 7 月 10 日	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所 2025 年 7 月 17 日
基金类型	债券型	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	王喆	开始担任本基金基金经理的日期	2025 年 7 月 10 日
		证券从业日期	2014 年 10 月 1 日
基金经理	闵锐	开始担任本基金基金经理的日期	2025 年 7 月 19 日
		证券从业日期	2015 年 10 月 1 日

注：本基金场内简称：科创债 ETF 嘉实。

二、基金投资与净值表现

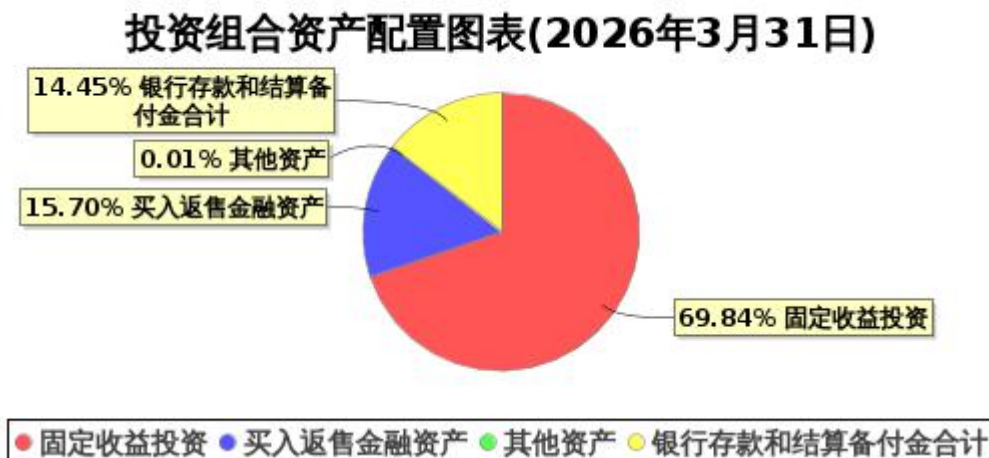
(一) 投资目标与投资策略

详见《嘉实中证 AAA 科技创新公司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”。

投资目标	本基金进行指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差控制在 2%以内。
投资范围	本基金主要投资于标的指数成份券和备选成份券。为更好地实现投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行、上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、超短期融资券、短期融资券、政府支持机构债券、可分离交易可转债的纯债部分等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、信用衍生品及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 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。 基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；本基金

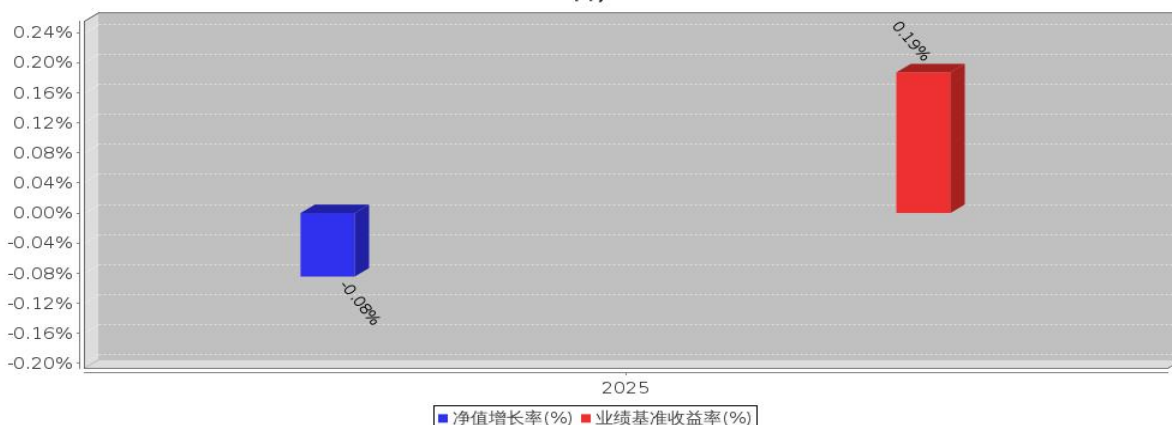
	<p>投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。国债期货和信用衍生品及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。</p> <p>若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。</p> <p>标的指数：中证 AAA 科技创新公司债指数。</p>
主要投资策略	<p>本基金为指数型基金，采用抽样复制和动态最优化的方法，选取标的指数成份券和备选成份券中流动性较好的债券，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。</p> <p>（一）债券指数化投资策略</p> <p>基于基金流动性管理和有效利用基金资产的需要，本基金将投资于流动性较好的指数成份券，保证基金资产流动性，提高基金资产的投资收益。本基金将根据宏观经济、货币政策和市场结构的变化，判断利率走势，优化组合结构；结合信用风险的判断和债券定价技术，优选个券。</p> <p>1、抽样复制策略</p> <p>本基金主要采取债券指数化投资策略，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金通过对标的指数中各成份券的久期、信用资质、历史流动性及收益率等进行分析，构建与标的指数风险收益特征相似的投资组合，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。此外本基金在控制跟踪误差的前提下，可通过风险可控的积极管理获得超额收益，力争弥补基金费用等管理成本，尽量缩小与标的指数的偏离度。</p> <p>2、替代性策略</p> <p>当市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券无法满足投资需求时，基金管理人将通过投资其他债券等方式进行替代。</p> <p>（二）衍生品投资策略</p> <p>（三）资产支持证券投资策略</p>
业绩比较基准	中证 AAA 科技创新公司债指数收益率
风险收益特征	<p>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。</p> <p>本基金为指数型基金，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。</p>

（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

嘉实中证AAA科技创新公司债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 (2025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

投资者在申购或赎回本基金时，申购赎回代理券商可按照不超过 0.5% 的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记机构等收取的相关费用；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/年费率或金额	收取方
管理费	0.15%	基金管理人、销售机构
托管费	0.05%	基金托管人
审计费用	68,000.00 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信息披露费用、会计师费、律师费和诉讼费或仲裁费，基金份额持有人大会费用，因基金的证券、期货、信用衍生品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），基金的银行汇划费用，基金的开户费用、账户维护费用，基金的上市初费和年费，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：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

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

基金运作综合费率（年化）
0.20%

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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。

1、本基金特有的风险：

具体包括：标的指数回报与债券市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险及跟踪误差未达约定目标的风险、标的指数变更的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份券停牌的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险（如有）、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、流动性风险、第三方机构服务的风险。

2、基金管理过程中共有的风险：

市场风险、信用风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险、投资于国债期货的特定风险、投资于信用衍生品的特定风险、投资于资产支持证券的风险以及其他风险。

（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；客服电话：400-600-8800。

- 1、《嘉实中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
《嘉实中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
《嘉实中证 AAA 科技创新公司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