

嘉实润和量化 6 个月定期开放混合型证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2024 年 9 月 23 日

送出日期：2024 年 9 月 25 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	嘉实润和量化定期混合	基金代码	005166
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日	2018 年 2 月 9 日	上市交易所及上市日期	-
基金类型	混合型	交易币种	人民币
运作方式	定期开放式	开放频率	每 6 个月开放一次
基金经理	端时立	开始担任本基金基金经理的日期	2023 年 1 月 10 日
		证券从业日期	2014 年 12 月 1 日

二、基金投资与净值表现

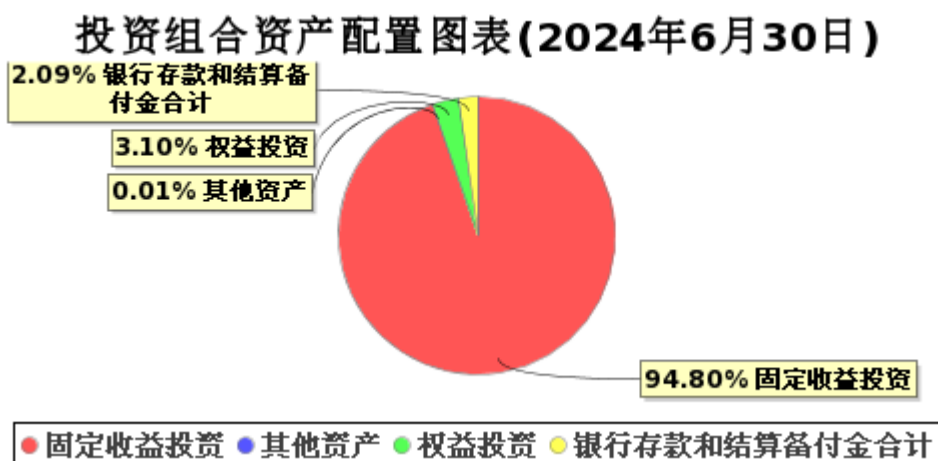
(一) 投资目标与投资策略

详见《嘉实润和量化 6 个月定期开放混合型证券投资基金招募说明书》第十部分“基金的投资”。

投资目标	本基金通过量化选股和主动债券投资相结合的投资策略，在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资范围	<p>本基金投资于依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他依法发行上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、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、中小企业私募债）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、权证、股指期货、国债期货、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>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>本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-30%。开放期内，本基金每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券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；在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但每个交易日日终在扣除期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。如法律法规或中国证监会允许，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	（一）封闭期投资策略：本基金将及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券

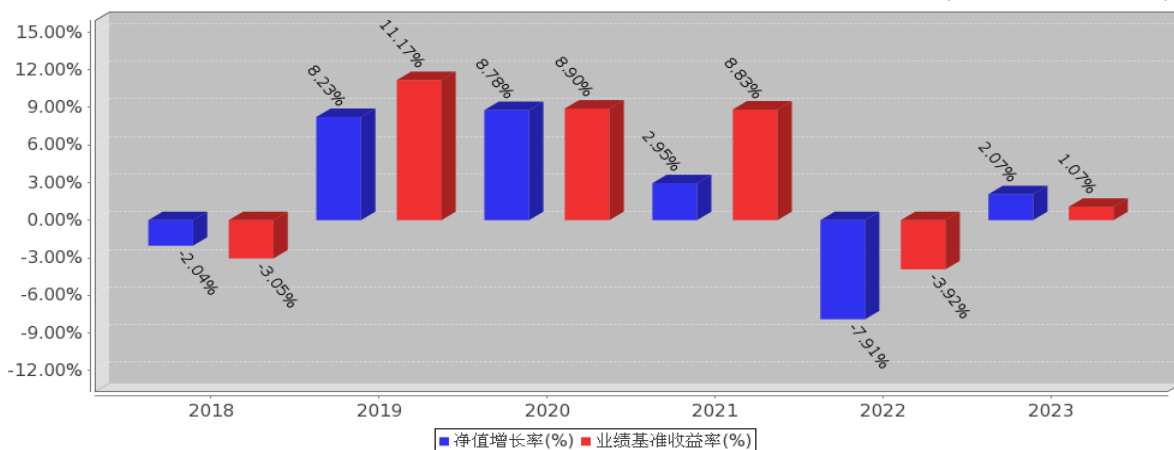
	<p>市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上，采用动态调整策略，在市場上涨阶段中，适当增加权益类资产配置比例，在市場下行周期中，适当降低权益类资产配置比例，力求实现基金财产的长期稳定增值，从而有效提高不同市場状况下基金资产的整体收益水平。具体包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略。</p> <p>(二) 开放期投资策略：开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中债总财富指数收益率×70%+中证 500 指数收益率×30%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。</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

嘉实润和量化定期混合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 (2023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：

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 < 1,000,000	1.2%	-
	1,000,000 ≤ M < 2,000,000	0.9%	-
	2,000,000 ≤ M < 5,000,000	0.6%	-
	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 ≤ 1	1.5%	封闭期数
	1 < N ≤ 2	0.75%	封闭期数
	2 < N ≤ 3	0.5%	封闭期数
	3 < N ≤ 4	0.25%	封闭期数
	N > 4	0%	封闭期数

注：赎回费中 N 为持续持有的封闭期数。

(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	1.2%	基金管理人、销售机构
托管费	0.2%	基金托管人
审计费用	40,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	80,000.00 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

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）
1.69%

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。

一) 本基金特有的风险

本基金以定期开放方式运作，在封闭期内，本基金不接受基金份额的申购和赎回，也不上市交易。因此，在封闭期内，基金份额持有人将面临因不能赎回或卖出基金份额而出现的流动性约束。

本基金投资中小企业私募债券，当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

本基金可投资于资产支持证券，因此可能面临资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、法律风险和操作风险。

本基金可投资于投资流通受限证券，因此面临流通受限证券在锁定期内没有流动性且无法变现的风险。本基金管理人将根据本基金定期开放运作的特点，在考虑到本基金投资的安全性、流动性和收益性的情况下，合理控制开放期与封闭期内本基金投资流通受限证券的比例，严格控制本基金投资流通受限证券的风险。

本基金还投资于股指期货/国债期货、权证等金融工具，而股指期货/国债期货、权证属于是高风险投资工具，相应市场的波动也可能给基金财产带来较高风险。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

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、《嘉实润和量化6个月定期开放混合型证券投资基金基金合同》

《嘉实润和量化6个月定期开放混合型证券投资基金托管协议》

《嘉实润和量化6个月定期开放混合型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