

嘉实致兴定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

基金产品资料概要更新

编制日期：2024年4月1日

送出日期：2024年4月3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 | 嘉实致兴定期纯债债券 | 基金代码 | 005670 |
| 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 | 2018年6月8日 | 上市交易所及上市日期 | - |
| 基金类型 | 债券型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 定期开放式 | 开放频率 | 每三个月开放一次 |
| 基金经理 | 赵国英 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2023年4月27日 |
| | | 证券从业日期 | 2004年5月1日 |
| 基金经理 | 王立芹 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2020年12月24日 |
| | | 证券从业日期 | 2007年11月1日 |
| 其他 | <p>《基金合同》生效之日起三年后的对应日，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。</p> <p>《基金合同》生效三年后继续存续的，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60个工作日出现前述情形的，在履行适当程序后，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。</p> <p>法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。</p> | | |

二、基金投资与净值表现

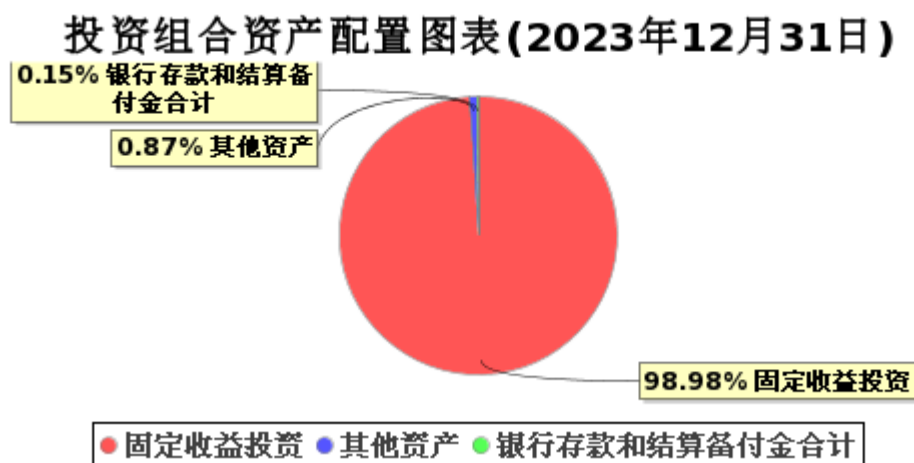
(一) 投资目标与投资策略

详见《嘉实致兴定期开放纯债债券型发起式证券投资基金招募说明书》第九部分“基金的投资”。

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资范围 | 本基金主要投资于国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等债券，以及资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金等，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）。本基金不投资于股票、权证等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。 |

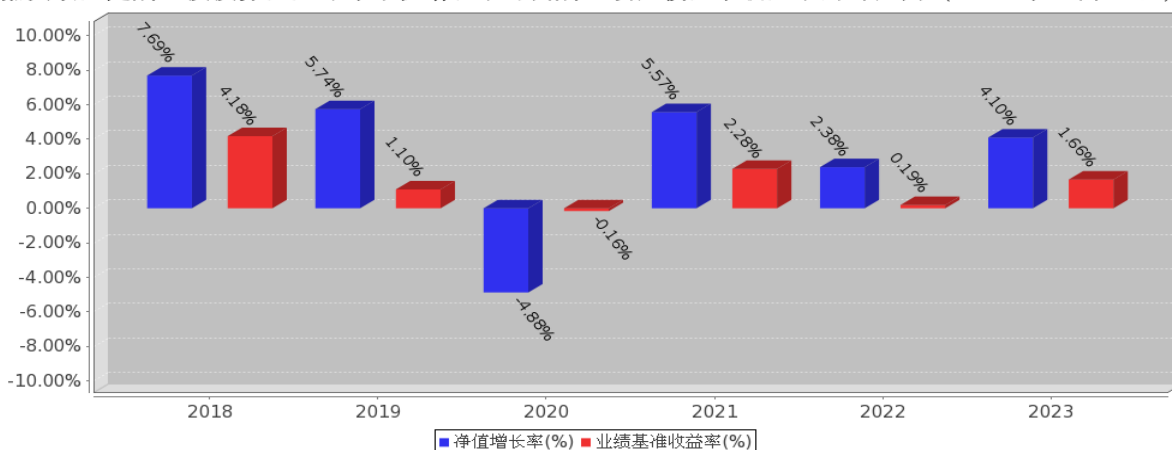
| | |
|--------|--|
| | <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%（开放期开始前 10 个工作日至开放期结束后 10 个工作日内，基金投资不受此比例限制）；在开放期内，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。</p> |
| 主要投资策略 | <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>1、债券投资策略：本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的投资收益。具体包括：利率策略、信用债券投资策略（个别债券选择、行业配置、信用风险控制措施）、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略、中小企业私募债券投资策略。</p> <p>2、资产支持证券投资策略：本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整后收益高的品种进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>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> |
| 业绩比较基准 | 中债总全价指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。 |

（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

嘉实致兴定期纯债债券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 |
|--------------|---------------------------|-----------|
| 申购费 (前收费) | M < 1,000,000 | 0.8% |
| | 1,000,000 ≤ M < 3,000,000 | 0.5% |
| | 3,000,000 ≤ M < 5,000,000 | 0.3% |
| | M ≥ 5,000,000 | 1,000 元/笔 |
| 赎回费 | N < 7 天 | 1.5% |
| | 7 天 ≤ N < 30 天 | 0.1% |
| | N ≥ 30 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 |
|------|--|
| 管理费 | 0.3% |
| 托管费 | 0.1% |
| 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，基金份额持有人大会费用，基金的证券交易费用，基金的银行汇划费用，开户费用、账户维护费用，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。本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。 |

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。

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

本基金为债券型基金，债券的投资比例不低于基金资产的 80%（开放期开始前 10 个工作日至开放期结束后 10 个工作日内，基金投资不受此比例限制），各类债券的特定风险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险。本基金以定期开放的方式运作，在本基金的封闭运作期间，基金份额持有人面临不能赎回基金份额的风险。

本基金为发起式基金，本基金发起资金提供方对本基金的认购，并不代表对本基金的风险或收益的任何判断、预测、推荐和保证，发起资金也并不用于对投资者投资亏损的补偿，投资者及发起资金提供方均自行承担投资风险。本基金发起资金认购的本基金份额持有期限自基金合同生效日起满 3 年后，发起资金提供方将根据自身情况决定是否继续持有，届时发起资金提供方有可能赎回认购的基金份额。另外，基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止。因此，投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。本基金为定制基金，单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过 50%，本基金不向个人投资者公开销售。本基金特定机构投资者赎回可能会导致基金份额净值波动的风险。

本基金投资中小企业私募债，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。

本基金投资资产支持证券，可能面临利率风险、流动性风险、现金流预测风险。

2、基金管理过程中共有的风险

具体包括市场风险、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、《嘉实致兴定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》

《嘉实致兴定期开放纯债债券型发起式证券投资基金托管协议》

《嘉实致兴定期开放纯债债券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

六、其他情况说明

本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过 50%，本基金不向个人投资者销售。

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投资组合资产配置图表、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信息。