嘉实国证自由现金流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：2025 年 12 月 23 日

送出日期：2025 年 12 月 26 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	嘉实国证自由现金流 ETF	**基金代码**	159221	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	**基金托管人**	中国工商银行股份有限公司	
基金合同生效日	2025 年 4 月 30 日	**上市交易所及上市日期**	深圳证券交易所	2025 年 5 月 13 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	尚可	**开始担任本基金基金经理的日期**	2025 年 4 月 30 日	
		证券从业日期	2020 年 3 月 1 日	

注：本基金场内简称：现金流 ETF 嘉实。

二、基金投资与净值表现

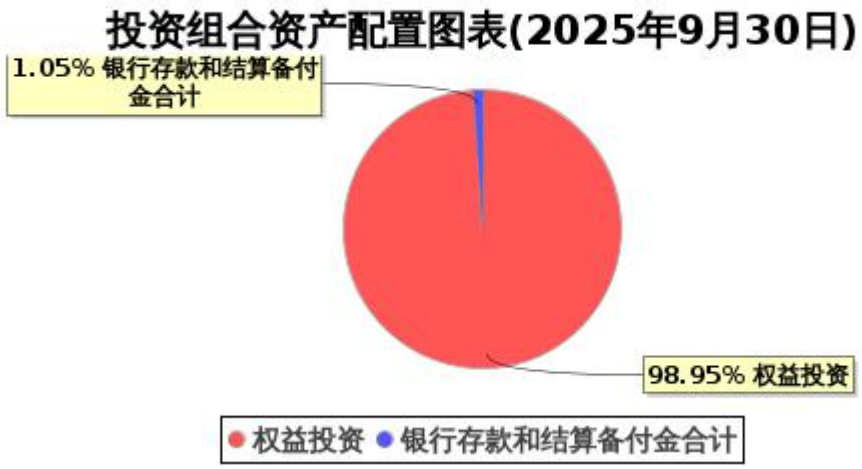
(一) 投资目标与投资策略

详见《嘉实国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》第十部分“基金的投资”。

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资范围	本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证，下同）。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（包含创业板、科创板、存托凭证及其他依法发行上市的股票）、债券资产（国债、地方政府债、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）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、衍生工具（股指期货、股票期权、国债期货等）、债券回购、银行存款、同业存单、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）。 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。 本基金投资标的指数成份股及备选成份股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%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。股指期货、股票期权和国债期货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。 标的指数：国证自由现金流指数。
主要投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票

	投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原因等）导致无法完全投资于标的指数成份股时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。 具体投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	国证自由现金流指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

(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

投资者在申购或赎回本基金时，申购赎回代理机构可按照不超过 0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算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	28,000.00 元	会计师事务所
信息披露费	101,096.00 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、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、标的指数变更的风险

5、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

6、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

7、退市风险

8、投资者申购失败的风险

9、投资者赎回失败的风险

10、基金份额赎回对价的变现风险，即流动性风险

11、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险

12、第三方机构服务的风险

13、指数编制机构停止服务的风险

14、成份股停牌的风险

15、采用证券经纪商交易结算模式的风险

二）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、投资于股指期货的特定风险、投资于股票期权的特定风险、投资于国债期货的特定风险、融资及转融通证券出借的风险、投资于资产支持证券的风险、存托凭证的投资风险、科创板投资风险、北京证券交易所投资风险以及其他风险。

(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、《嘉实国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
《嘉实国证自由现金流交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
《嘉实国证自由现金流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