

永赢上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指
数证券投资基金
上市交易公告书

基金管理人：永赢基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2025 年 9 月 24 日

公告日期：2025 年 9 月 19 日

目录

一、重要声明与提示	3
二、基金概览	4
三、基金的募集与上市交易	5
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人	8
五、基金主要当事人简介	9
六、基金合同摘要	15
七、基金财务状况	16
八、基金投资组合	18
九、重大事项揭示	21
十、基金管理人承诺	22
十一、基金托管人承诺	23
十二、基金上市推荐人意见	24
十三、备查文件目录	25
附件：基金合同内容摘要	27

一、重要声明与提示

永赢上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号<上市交易公告书的内容与格式>》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，永赢基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“本公司”）的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中信建投证券股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资人详细查阅 2025 年 9 月 9 日刊登在本基金管理人网站（<http://www.maxwealthfund.com>）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）、上海证券交易所网站上的《永赢上证 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》（以下简称“招募说明书”）。

二、基金概览

（一）基金名称：永赢上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金

（二）基金场内简称：科债永赢（扩位简称：科创债 ETF 永赢）

（三）基金代码：511150

（四）基金份额总额：截至 2025 年 9 月 17 日，本基金份额总额 2,953,090,333.00 份（折算前份额）

（五）基金份额净值：截至 2025 年 9 月 17 日，本基金基金份额净值 1.0001 元（折算前份额净值）

（六）本次上市交易基金份额总额：2,953,090,333.00 份（折算前份额）

（七）上市交易的证券交易所：上海证券交易所

（八）上市交易日期：2025 年 9 月 24 日

（九）基金管理人：永赢基金管理有限公司

（十）基金托管人：中信建投证券股份有限公司

（十一）登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

（十二）上市推荐人：中信建投证券股份有限公司

（十三）申购赎回代理券商：渤海证券股份有限公司、东方财富证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国联民生证券股份有限公司、国泰海通证券股份有限公司、国投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华宝证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、金元证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、湘财证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中国银河

证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司

若有新增本基金的申购、赎回代办券商，本公司将另行公告。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的注册机构和准予注册文号：中国证券监督管理委员会证监许可〔2025〕1993 号文。

2、基金运作方式：交易型开放式。

3、基金合同期限：不定期。

4、发售日期：本基金的发售期为 2025 年 9 月 12 日。其中网下现金认购的日期为 2025 年 9 月 12 日，网上现金认购的日期为 2025 年 9 月 12 日。

5、发售价格：1.00 元人民币。

6、发售方式：投资者可以选择网上现金认购和网下现金认购 2 种方式。

7、发售机构

（1）网下现金发售直销机构

永赢基金管理有限公司

（2）网下现金发售代理机构

东方财富证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司

（3）网上现金发售代理机构

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理，具体名单可在上海证券交易所网站查询。

8、验资机构：安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。

9、募集资金总额及入账情况

截至 2025 年 9 月 12 日，本基金募集工作已顺利结束。经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的有效总净认购金额为人民币 2,953,032,000.00 元（其中现金人民币 2,953,032,000.00 元，债券计价人民币 0 元），折合基金份额 2,953,032,000.00 份。认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币 109,920.06 元，其中，通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息为 58,333.33 元，折合基金份额 58,333.00 份，归基金份额持有人所有；网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息为 51,586.73 元，计入基金财产，不折算为投资者基金份额。本次募集无网下债券认购。本次以现金认购的所有资金已于 2025 年 9 月 17 日全额划入本基金在基金托管人中信建投证券股份有限公司开立的本基金托管专户。

本次募集有效认购户数为 1,486 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本次募集有效认购份额及由利息结转的基金份额共计 2,953,090,333.00 份，已全部计入基金份额持有人的基金账户，归各基金份额持有人所有。本基金管理人及本公司的基金从业人员没有认购本基金。本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不在基金财产中列支。

10、基金备案情况

根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《永赢上证 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》（以下简称“基金合同”）、《永赢上证 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》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于 2025 年 9 月 17 日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

11、基金合同生效日：2025 年 9 月 17 日。

12、基金合同生效日的基金份额总额：2,953,090,333.00 份（折算前份额）。

（二）基金份额折算

根据本基金基金合同和招募说明书的有关规定，本基金管理人确定 2025 年 9 月 18 日为本基金的基金份额折算日，具体情况详见相关公告。基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生实质性变化。除小数点尾数处理外，基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

（三）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书 [2025]222 号

2、上市交易日期：2025 年 9 月 24 日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

4、基金场内简称：科债永赢（扩位简称：科创债 ETF 永赢）

5、基金代码：511150

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

本基金管理人自 2025 年 9 月 24 日开始办理本基金的申购和赎回业务。投资者应当在本基金指定的申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。

6、本次上市交易份额：2,953,090,333.00 份（折算前份额）

7、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

本章节相关基金份额数据根据折算前份额统计而来。

（一）持有人户数

截至 2025 年 9 月 17 日，本基金基金份额持有人户数为 1,486 户，平均每户持有的基金份额为 1,987,274.79 份。

（二）持有人结构

截至 2025 年 9 月 17 日，机构投资者持有的本基金基金份额为 2,948,017,333.00 份，占基金总份额的 99.83%；个人投资者持有的本基金基金份额为 5,073,000.00 份，占基金总份额的 0.17%。

（三）前十名基金份额持有人的情况

截至 2025 年 9 月 17 日，本基金前十名基金份额持有人情况如下：

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占总份额比例（%）
1	申万宏源证券资管—渤海银行股份有限公司—申万宏源渤远长三角主题单一资产管理计划	300,058,333.00	10.16
2	中国银河证券股份有限公司	250,000,000.00	8.47
3	招商证券股份有限公司	200,000,000.00	6.77
4	招商证券股份有限公司	200,000,000.00	6.77
5	国投证券股份有限公司	200,000,000.00	6.77
6	东方证券股份有限公司	200,000,000.00	6.77
7	兴业证券股份有限公司	200,000,000.00	6.77
8	申万宏源证券有限公司	199,996,000.00	6.77
9	中信建投证券股份有限公司	150,000,000.00	5.08
10	中信建投证券股份有限公司	110,000,000.00	3.72

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、基金管理人概况

名称：永赢基金管理有限公司

住所：浙江省宁波市鄞州区中山东路 466 号

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 210 号 21 世纪大厦 21、22、23、27 层

法定代表人：马宇晖

总经理：芦特尔

信息披露负责人：汪成杰

设立日期：2013 年 11 月 7 日

联系电话：400-805-8888

传真：(021) 5169 0177

注册资本：玖亿元人民币

设立批准文号：中国证监会证监许可[2013]1280 号

工商登记注册的法人营业执照文号：913302007178854322

经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的业务。

股权结构：宁波银行股份有限公司出资人民币 643,410,000 元，占公司注册资本的 71.49%；Oversea-Chinese Banking Corporation Limited 出资人民币 256,590,000 元，占公司注册资本的 28.51%。

2、内部组织结构及职能

永赢基金管理有限公司自成立以来，严格按照法律法规和中国证监会的规定和要求，建立起科学有效的组织架构，并致力于不断完善公司内部控制管理，确保公司规范稳健运营，维护基金份额持有人的利益。

股东会是公司的权力机构，根据公司的目标和经营范围，决定公司的经营方针、固有资金投资计划和经营政策。设董事会向股东会负责，执行股东会的决议。董事会下设审计及风险管理委员会、资格审查和薪酬委员会。

公司日常经营管理工作由总经理负责，并设立总经理办公会议，由公司总经

理办公室高级管理人员组成，对公司经营管理重大事项进行会议决策。同时设立 IT 治理委员会、产品委员会、投资决策委员会、估值委员会、风险控制委员会等专业委员会就具体事项进行讨论和决定。

公司目前下设二十一个部门、三个分公司，分别为权益投资部、固定收益投资部、固定收益研究部、混合资产投资部、FOF 投资部、国际业务部、绝对收益投资部、指数量化与券商业务总部、机构业务总部、渠道业务总部、电子商务部、交易部、产品部、合规部、风险管理部、审计部、基金运营部、信息技术部、财务部、人力资源部、行政部、上海分公司、北京分公司和广州分公司。

3、人员情况

截至 2025 年 6 月 30 日，永赢基金正式员工 363 人，其中 309 人具有硕士及以上学历。

4、基金管理业务情况

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 155 只证券投资基金，产品类型较为完备且覆盖各类风险等级。

5、本基金基金经理

连冰洁女士，复旦大学金融学硕士，8 年证券相关从业经验。曾任博时基金管理有限公司固定收益总部基金经理助理兼高级研究员；路博迈基金管理有限公司固定收益部投资经理及 EMD 高级分析师；上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益投资部投资经理。现任永赢基金管理有限公司固定收益投资部基金经理。2024 年 12 月 31 日至今，担任永赢荣益债券型证券投资基金的基金经理；2024 年 12 月 31 日至今，担任永赢泽利一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2025 年 04 月 08 日至今，担任永赢增益债券型证券投资基金的基金经理；2025 年 08 月 20 日至今，担任永赢中债-优选投资级信用债(1-3 年)指数证券投资基金的基金经理；2025 年 09 月 17 日至今，担任永赢上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

牟琼屿女士，中国人民大学经济学硕士，16 年证券相关从业经验。曾任中融国际信托固定收益部交易员，国开证券固定收益部投资经理，现任永赢基金管理有限公司固定收益投资部基金经理。2018 年 03 月 22 日至 2021 年 01 月 20 日，担任永赢永益债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 03 月 22 日至 2019 年 12

月 19 日，担任永赢丰利债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 04 月 02 日至 2019 年 09 月 27 日，担任永赢丰益债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 04 月 02 日至 2019 年 09 月 27 日，担任永赢添益债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 04 月 02 日至 2021 年 01 月 04 日，担任永赢瑞益债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 08 月 28 日至 2019 年 12 月 19 日，担任永赢聚益债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 10 月 12 日至今，担任永赢祥益债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 11 月 01 日至 2019 年 11 月 22 日，担任永赢恒益债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 11 月 01 日至 2019 年 11 月 22 日，担任永赢润益债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 11 月 07 日至今，担任永赢诚益债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 11 月 22 日至 2019 年 12 月 11 日，担任永赢通益债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 11 月 29 日至 2019 年 12 月 19 日，担任永赢昌益债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 12 月 05 日至 2020 年 06 月 18 日，担任永赢宏益债券型证券投资基金的基金经理；2018 年 12 月 13 日至 2019 年 12 月 19 日，担任永赢伟益债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 01 月 18 日至 2020 年 06 月 18 日，担任永赢颐利债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 03 月 14 日至 2020 年 03 月 20 日，担任永赢中债-1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理；2019 年 04 月 11 日至 2020 年 04 月 16 日，担任永赢泰利债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 05 月 09 日至 2022 年 08 月 29 日，担任永赢悦利债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 05 月 09 日至 2020 年 06 月 18 日，担任永赢卓利债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 05 月 17 日至 2022 年 02 月 07 日，担任永赢凯利债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 06 月 05 日至 2025 年 01 月 09 日，担任永赢惠泽一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 06 月 17 日至 2021 年 01 月 04 日，担任永赢智益纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 07 月 11 日至 2020 年 07 月 31 日，担任永赢众利债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 07 月 18 日至今，担任永赢同利债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 07 月 24 日至 2020 年 07 月 31 日，担任永赢昌利债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 08 月 28 日至 2020 年 11 月 09 日，担任永赢开泰中高等级中短债债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 10 月 17 日至 2021

年 06 月 23 日，担任永赢淳利债券型证券投资基金的基金经理；2019 年 12 月 05 日至 2024 年 01 月 29 日，担任永赢久利债券型证券投资基金的基金经理；2020 年 02 月 28 日至今，担任永赢元利债券型证券投资基金的基金经理；2021 年 01 月 20 日至 2022 年 02 月 07 日，担任永赢卓利债券型证券投资基金的基金经理；2021 年 06 月 23 日至今，担任永赢通益债券型证券投资基金的基金经理；2023 年 12 月 18 日至今，担任永赢颐利债券型证券投资基金的基金经理；2024 年 08 月 30 日至今，担任永赢荣益债券型证券投资基金的基金经理；2024 年 08 月 30 日至 2025 年 09 月 09 日，担任永赢裕益债券型证券投资基金的基金经理；2024 年 09 月 18 日至今，担任永赢丰益债券型证券投资基金的基金经理；2024 年 09 月 18 日至今，担任永赢丰利债券型证券投资基金的基金经理；2025 年 09 月 17 日至今，担任永赢上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

（二）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中信建投证券股份有限公司（简称中信建投证券）

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区景辉街 16 号院 1 号楼泰康集团大厦 8 层

法定代表人：刘成

成立日期：2005 年 11 月 02 日

批准设立机关和批准设立文号：证监会、证监机构字【2005】112 号

基金托管业务批准文号：证监许可〔2015〕219 号

注册资本：人民币 775669.4797 万元

存续期间：持续经营

联系电话：010-56135357

联系人：邱珂磊

中信建投证券成立于 2005 年 11 月 2 日，是经中国证监会批准设立的全国性大型综合证券公司。公司注册于北京，注册资本 775669.4797 万元，并设有中信建投期货有限公司、中信建投资本管理有限公司、中信建投（国际）金融控股有限公司、中信建投基金管理有限公司和中信建投投资有限公司等 5 家全资子公司。自成立以来，中信建投证券各项业务快速发展，在企业融资、收购兼并、证券经纪、证券金融、固定收益、资产管理、股票及衍生品交易等领域形成了自身特色和核心业务优势，并搭建了研究咨询、信息技术、运营管理、风险管理、合规管理等专业高效的业务支持体系。公司拥有均衡全能且行业领先的投资银行业务、产品谱系健全和买方投顾能力持续提升的财富管理业务、专业综合的交易和机构客户服务能力，以及增长迅速且潜力巨大的“大资管”业务。目前公司正在深入推进子公司一体化管理，确保公司资源效能最大化、客户服务综合化、业务发展规模化。凭借高度的敬业精神与突出的专业能力，中信建投证券主要经营指标目前均位居行业前列。

2、主要人员情况

中信建投证券托管部管理团队和业务骨干具有丰富的证券投资基金托管业务运作经验，业务人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域，可为托管客户提供个性化产品处理能力。

3、基金托管业务经营情况

中信建投证券于 2015 年 2 月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格，中信建投证券始终遵循“诚信、专注、成长、共赢”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护基金份额持有人的合法权益，为基金份额持有人提供高质量的托管服务。

（三）基金上市推荐人

名称：中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区景辉街 16 号院 1 号楼泰康集团大厦 8 层

法定代表人：刘成

成立日期：2005 年 11 月 02 日

批准设立机关和批准设立文号：证监会、证监机构字【2005】112 号

基金托管业务批准文号：证监许可〔2015〕219 号

注册资本：人民币 775669.4797 万元

存续期间：持续经营

联系电话：010-56135357

联系人：邱珂磊

（四）验资机构

名称：安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：石静筠

经办注册会计师：石静筠、沈熙苑

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同内容摘要。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

截至 2025 年 9 月 17 日，本基金的资产负债表如下（未经审计）：

单位：人民币元

资 产	本期末 2025 年 9 月 17 日
资 产：	
货币资金	2,953,188,769.67
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	-
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收清算款	-
应收股利	-

应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	51,586.73
资产总计	2,953,240,356.40
负债和净资产	本期末 2025 年 9 月 17 日
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	-
应付托管费	-
应付销售服务费	-
应付投资顾问费	-
应交税费	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	1,792.46
负债合计	1,792.46
净资产：	
实收基金	2,953,090,333.00
未分配利润	148,230.94
净资产合计	2,953,238,563.94
负债和净资产总计	2,953,240,356.40

注：报告截止日 2025 年 9 月 17 日，本基金基金份额净值为 1.0001 元，基金份额总额为 2,953,090,333.00 份。

八、基金投资组合

本基金目前处于建仓期，在上市首日前，基金管理人将使本基金的投资组合比例符合有关法律法规、部门规章、规范性文件的规定和基金合同的有关约定。

截至 2025 年 9 月 17 日，本基金的投资组合情况如下：

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,953,188,769.67	100.00
8	其他资产	51,586.73	0.00
9	合计	2,953,240,356.40	100.00

注：本基金将按照相关法律法规的要求，在上市前完成基金投资组合与标的指数的拟合。

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

1、按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

（三）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

（八）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

（九）报告期末本基金投资股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

（十）报告期末本基金投资国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

1、基金管理人于 2025 年 9 月 17 日未投资证券，因此不存在投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、本基金于 2025 年 9 月 17 日没有投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况。

3、期末其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	51,586.73
7	其他	-
8	合计	51,586.73

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金于2025年9月17日未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金于2025年9月17日前十名股票中不存在流通受限的情况。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事项揭示

本基金以 2025 年 9 月 18 日为基金份额折算日进行了基金份额折算，详见 2025 年 9 月 18 日披露的《永赢基金管理有限公司关于永赢上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》及 2025 年 9 月 19 日披露的基金份额折算结果公告。

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、上海证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出以下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定和约定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定和约定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理费的计提和支付、基金托管费的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时通知基金管理人限期纠正，并在限期内随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人就基金上市交易事宜出具意见如下：

1.本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件。

2.基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载资料均经过核实。

十三、备查文件目录

（一）备查文件目录

1、中国证监会准予永赢上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金注册的批复；

2、《永赢上证 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》；

3、《永赢上证 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》；

4、《永赢上证 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》及其更新（如有）；

5、上海源泰律师事务所关于申请募集永赢上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金之法律意见；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

（二）存放地点

备查文件存放在基金管理人、基金托管人的办公场所。

（三）查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

风险提示：本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

永赢基金管理有限公司

2025 年 9 月 19 日

附件：基金合同内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（1）依法募集资金；

（2）自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；

（3）依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

（4）销售基金份额；

（5）按照规定召集基金份额持有人大会；

（6）依据基金合同及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用；

（10）依据基金合同及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；

（11）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使相关权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 选择、更换基金申购赎回代理机构，对基金申购赎回代理机构的相关行为进行监督和处理；

(17) 在不违反有关法律、法规、上海证券交易所及登记机构相关业务规则、通知、指南的规定以及本基金合同的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等的业务规则；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理基金备案手续；

(3) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格、申购对价、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的对价，编制申购赎回清单；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他

人泄露，但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要而向其提供的情况除外；

（13）按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付基金份额持有人赎回对价；

（15）依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料，保存期限不低于法律法规规定的最低期限；

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

（18）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（19）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

（20）因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

（23）以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人，对于基金募集期间网下债券认购所募

集的债券，发售代理机构应予以解冻；

（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（26）建立并保存基金份额持有人名册；

（27）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（二）基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

（1）自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

（2）依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

（3）监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

（4）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；

（5）提议召开或召集基金份额持有人大会；

（6）在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

（2）设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

（4）除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为

自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

（5）保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

（6）按规定开设基金财产的资金账户、证券账户等投资所需其他账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但因监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要而向其提供的情况除外；

（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回对价；

（9）办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

（10）对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（11）保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存期限不低于法律法规规定的最低期限；

（12）从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

（13）按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

（14）依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回对价的现金部分；

（15）依据《基金法》、基金合同及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

（16）按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

（17）参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会，并通知基金管理人；

（19）因违反基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任

不因其退任而免除；

（20）按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

（21）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（22）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（三）基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

（1）分享基金财产收益；

（2）参与分配清算后的剩余基金财产；

（3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

（4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

（5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

（6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

（7）监督基金管理人的投资运作；

（8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

（9）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

（1）认真阅读并遵守基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等信息披

露文件；

（2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

（3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

（4）交纳基金认购款项或债券、申购对价及基金合同规定的费用；

（5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

（6）不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；

（7）执行生效的基金份额持有人大会的决议；

（8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

（9）提供基金管理人和监管机构等依法要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实、准确、完整；

（10）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会未设日常机构。在本基金存续期内，根据本基金的运作需要，基金份额持有人大会可以设立日常机构，日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。

若以本基金为目标基金，且基金管理人与本基金基金管理人一致的联接基金的基金合同生效，鉴于本基金和本基金的联接基金的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的份额直接参加或者委派代表参加本基金的基金份额持有人大会表决。在计算参会份额和计票时，联接基金基金份额持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。联接基金折算为本基金后的每一参会份额和本基金的每一参会份额拥有平等的投票权。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金基金份额持有人大会的，须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金基金份额持有人大会。

（一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，但法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外：

- （1）终止基金合同；
- （2）更换基金管理人；
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式；
- （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求调整该等报酬标准的除外；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- （11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人或基金托管人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- （12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- （13）终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所决定终止上市的情形除外；

(14) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和基金合同约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 调整本基金的申购费率、变更收费方式、增加、减少或调整本基金的基金份额类别、调整基金份额分类办法及规则；

(3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或者登记机构的相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(5) 在法律法规和中国证监会允许范围内，调整有关认购、申购、赎回、转换、交易、转托管、非交易过户、质押等业务规则（包括申购赎回清单的调整、开放时间的调整等），或证券交易所和登记机构调整上述业务规则；

(6) 在履行适当程序后，基金推出新业务或服务；

(7) 调整基金的申购赎回方式；调整申购对价、赎回对价组成，调整申购赎回清单的内容，调整基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间或频率；

(8) 募集并管理以本基金为目标 ETF 的一只或多只联接基金，在其他证券交易所上市、开通跨系统转托管等业务；

(9) 在不违反法律法规的情况下，本基金的联接基金采取特殊申购或其他方式参与本基金的申购赎回；

(10) 调整基金收益分配原则；

(11) 本基金的联接基金采取特殊申购或其他方式参与本基金的申购赎回；

(12) 基金开通场外申购、赎回等相关业务；

(13) 按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管

理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

(3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

(4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

(5) 会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3

个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按基金合同约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

（4）上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

3、在不与法律法规冲突的前提下，经会议通知载明，本基金的基金份额持有人可采用其他书面或非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会。在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相

结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人或其代理人可以采用书面、网络、电话或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如基金合同的重大修改、决定终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及基金合同规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（七）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有异

议，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证,基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

（八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金的收益与分配、执行方式

（一）基金收益分配原则

- 1、本基金的收益分配方式为现金分红；
- 2、基金管理人可每月对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金的可

供分配利润进行评价，收益评价日核定的基金份额净值增长率超过业绩比较基准同期增长率或者基金可供分配利润金额大于零时，基金管理人可进行收益分配；

3、当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、在符合上述基金分红条件的前提下，本基金可每月进行收益分配。评价时间、分配时间、分配方案及每次基金收益分配数额等内容，基金管理人可以根据实际情况确定并按照有关规定公告；

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

（二）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（三）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

（四）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

- 3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、审计费、律师费、诉讼费和仲裁费等；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货、信用衍生品等交易、结算费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用；
- 9、基金上市费及年费、登记费用、IOPV 计算与发布费用；
- 10、收益分配中发生的费用；
- 11、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。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年实际天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年实际天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月

首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用；
- 4、基金的标的指数许可使用费，本基金的标的指数许可使用费由基金管理人承担；
- 5、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。对于基金份额持有人必须自行缴纳的税收，由基金份额持有人自行负责，基金管理人和基金托管人不承担代扣代缴或纳税的义务。

五、基金财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

（二）投资范围

本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，为更好实现投资目标，还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、地方政府债、次级债、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款（协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）、

同业存单、货币市场工具、信用衍生品、国债期货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，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

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%；其中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%；本基金参与国债期货交易，每个交易日日终在扣除国债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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，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。

（三）投资策略

本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券，或选择非成份券作为备选成份券，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的有效跟踪。

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%，年化跟踪误差不超过 2.0%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

1、债券指数化投资策略

（1）抽样复制策略

通过对标的指数成份券的历史数据进行分析，选取流动性较好的证券构造与标的指数久期、剩余期限、到期收益率等指标相近的投资组合，达到跟踪标的指数、降低交易成本的目的。

（2）替代性策略

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。

2、其他债券投资策略

除标的指数成份券及备选成份券以外，本基金可根据宏观经济变量和宏观经

济政策的分析，预测未来收益率曲线的变动趋势，综合考虑组合流动性决定投资品种。

3、国债期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易，以降低债券仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

4、信用衍生品投资策略

本基金在进行信用衍生品投资时，将根据风险管理的原则，以风险对冲为目的参与信用衍生品交易，获取信用衍生品标的债券的信用风险保护，改善组合的风险收益特性。

5、资产支持证券投资策略

本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

6、未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可在履行适当程序后在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。

（四）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；

（2）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；

（3）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但跟踪标的指数的指数化投资部分不计入本项限制；

（4）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过

基金资产净值的 10%;

(5) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;

(6) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;

(7) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

(8) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

(9) 本基金如投资于国债期货,还应遵循如下投资组合限制:

(9.1) 在任何交易日日终,本基金持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的 15%;

(9.2) 本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;

(9.3) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%;

(9.4) 本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

(9.5) 本基金每个交易日日终在扣除国债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,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等;

(10) 本基金不持有具有信用保护卖方属性的信用衍生品;不持有合约类信用衍生品;本基金持有的具有信用保护买方属性的信用衍生品名义本金不得超过本基金中所对应受保护债券面值的 100%;本基金投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品名义本金合计不得超过基金资产净值的 10%;因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 3 个月内调整;

(11) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值

的 15%；因证券/期货市场波动、证券停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（12）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

（13）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

（14）法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述（8）、（10）、（11）、（12）情形之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份券调整、标的指数成份券流动性限制或成份券市场价格变化等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但法律法规、中国证监会规定的特殊情形或基金合同另有约定的除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资；
- （6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

3、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循

基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

4、如法律法规或监管部门取消上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，本基金可不受相关限制，且无需召开基金份额持有人大会审议。法律法规或监管部门对上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本基金可以变更后的规定为准。经与基金托管人协商一致，基金管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对基金合同进行变更，该变更无须召开基金份额持有人大会审议。

（五）投资标的指数

本基金标的指数为上证 AAA 科技创新公司债指数。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作。

指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约等风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。

法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（六）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即上证 AAA 科技创新公司债指数收益率。

本基金以“紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化”作为投资目标，在投资中将不低于基金资产净值的 90% 的资产投资于标的指数成份券及备选成份券，因此选取上证 AAA 科技创新公司债指数收益率作为业绩比较基准，能够比较真实、客观地反映本基金的风险收益特征。

（七）风险收益特征

本基金为债券型基金，理论上其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金为指数型基金，主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。

（八）基金管理人代表基金行使债权人权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、有利于基金财产的安全与增值；
- 3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

六、基金资产估值

（一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券、期货交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

（二）估值对象

基金所拥有的债券、国债期货、银行存款本息、应收款项、资产支持证券、信用衍生品、其它投资等资产及负债。

（三）估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

- 1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价

值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

（四）估值方法

1、上市有价证券的估值

（1）交易所上市或挂牌转让的有价证券（本基金合同另有规定的除外），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值。

（3）对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值。

对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记

期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

2、对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

3、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

4、本基金投资国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日结算价估值。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

5、信用衍生品的估值方法：信用衍生品按第三方估值机构提供的当日估值价进行估值，但基金管理人依法应当承担的估值责任不因委托而免除；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，依照有关法律法规、行业协会的相关规定及企业会计准则要求采用合理估值技术确定公允价值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。法律法规及监管部门另有规定的，从其规定。

（五）估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。

法律法规、监管机构、本基金合同或会计准则等另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。如遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。

（六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，由此而造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责

任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

(5) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

（七）暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

（八）基金净值的确认

基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值按规定予以公布。

（九）特殊情况的处理方法

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第6项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力，或证券、期货交易所、存款银行或基金份额登记机构等机构发送的数据错误或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人等原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任，但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规

定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

（二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

3、出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；

4、基金合同约定的其他情形；

5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

（1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限可相应顺延。

(四) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存时间不低于法律法规规定的最低期限。

八、争议解决方式

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心），根据提交仲裁时该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用、律师费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责

地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

基金合同受中国法律（为基金合同之目的，在此不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同正本一式三份，除上报有关监管机构一份外，基金管理人、基金托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。