# 国泰中证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: 2025年11月24日

送出日期: 2025年11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    | 国泰中证 AAA 科技创新<br>公司债 ETF  | 基金代码               | 551800                |
| 基金管理人   | 国泰基金管理有限公司  | 基金托管人              | 兴业银行股份有限公司            |
| 基金合同生效日 | 2025-09-17  | 上市交易所及上<br>市日期     | 上海证券交易所<br>2025-09-24 |
| 基金类型    | 债券型   | 交易币种               | 人民币                   |
| 运作方式    | 交易型开放式  | 开放频率               | 每个开放日                 |
| 基金经理    | 王玉  | 开始担任本基金<br>基金经理的日期 | 2025-09-17            |
|         |   | 证券从业日期             | 2016-01-25            |
|         | 王振扬   | 开始担任本基金<br>基金经理的日期 | 2025-09-17            |
|         |   | 证券从业日期             | 2019-09-15            |
| 场内简称    | 国泰科债  |                    |                       |
|         | 科创债 ETF 国泰  |                    |                       |
| 其他      | 《基金合同》生效后,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,基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如持续运作、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。<br>法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。 |                    |                       |

# 二、基金投资与净值表现(一)投资目标与投资策略

详见本基金招募说明书 "第十一部分 基金的投资"。

| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。                                      |
|------|--|
| 投资范围 | 本基金主要投资于标的指数成份券、备选成份券。为更好地实现投资<br>目标,本基金可少量投资于国内依法发行上市的其他债券资产(包括 |

| 国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、中期票据、短期融资券等、政府支持机构债券、中期票据、短期融资券等、政府支持批为人产支持证券、同业全户、银行存款、货币市场工具、国债期货、信用行生品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)。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,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。如法律法规或监管机构以后允许基金资产的80%,因法律法规的规定而变更投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资范围及投资比例规定。本基金的标的指数为中证AAA科技创新公司债指数及其未来可能发生的变更。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、投资于标的指数中间,被当与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏高度规对标的指数的有效跟踪。在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏高规则调整或其他因素能避免跟踪偏高度和跟误误差超进进步扩大。本基金发作过程中,当标的指数成份券发进进步步面事件面临停牌或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;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略,替代性策略;国债期货投资策略;信用行生品投资策略,等产支持证券投资策略。中证AAA科技创新公司债指数收益率本基金为指数型基金,罪资期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金、混资即规位在特征与标的指数所表价债券市场组合的风险收益特征相似。 |                    |                                   |
|--|--------------------|-----------------------------------|
| 资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、国债期货、信用衍生品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)。 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产产净值的90%,且不的指数成份券的各进成份券的比例不低于基金资产净值的90%,且不。如法律法规或监管部机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资范围及投资比例规定。 本基金的标的指数为中证AAA科技创新公司债指数及其未来可能发生的变更。 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和备造成份券,或选择非成份券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差和超过上述范围,基金管理人应来取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应率取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 本基金运作且指数编制机构的暂未作出调整的,基金管理人应当按照基金份额持有人和益优先的原则,履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。 业绩比较基准  业绩比较基准  |                    | 国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地    |
| 行存款、货币市场工具、国债期货、信用衍生品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)。本基金投资于债券资产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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资范围及投资比例规定。本基金的标的指数为中证AAA科技创新公司债指数及其未来可能发生的变更。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产组合,以实现对标的指数的中具有代表性和流动性的成份券产组合的分资产组合有效跟踪。在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差和过2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和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偏高度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中,当标的指数保险的,是指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当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;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略,替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。 业绩比较基准  中证AAA科技创新公司债指数收益率 本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所  |                    | 方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、中期票据、短期融    |
| 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)。 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;其中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%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资范围及投资比例规定。 本基金的标的指数为中证AAA科技创新公司债指数及其未来可能发生的变更。 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和备选成份券,或选择非成份券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以现对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是迫求目均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪度产不超过2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟跟踪偏离度度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程被追求。跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程推施避免跟踪偏离离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当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;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。  业绩比较基准  中证AAA科技创新公司债指数收益率 本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金。,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所                                  |                    | 资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银    |
| 定)。 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;其中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%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资范围及投资比例规定。 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和备选成份券,或选择非成份券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求目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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致免跟踪偏离度和跟踪误差差进一步前事件面临停牌或基金管理人应采取合理措施避免跟踪踪偏离度、跟踪误差进一步前事件面临停牌或选约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;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。 业绩比较基准  中证AAA科技创新公司债指数收益率 本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金、跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所   |                    | 行存款、货币市场工具、国债期货、信用衍生品以及法律法规或中国    |
| 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;其中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%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资范围及投资比例规定。本基金的标的指数为中证AAA科技创新公司债指数及其未来可能发生的变更。  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和备选成份券,或选择非成份券作为替数的有效跟踪。在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和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偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中,当标的指数成份券发生明显负管理人应当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;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。中证AAA科技创新公司债指数收益率本基金属于债券型基金,再订明市场基金。本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所见险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所  |                    | 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     |
| 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%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资范围及投资比例规定。 本基金的标的指数为中证AAA科技创新公司债指数及其未来可能发生的变更。  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和备选成份券,或选择非成份券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和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偏离度和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偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中,当标的指数成份券发生明显负面事件面临停牌或违约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当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;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。  业绩比较基准  中证AAA科技创新公司债指数收益率  本基金属于债券型基金,再于货币市场基金。本基金属于债券型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所   |                    | 定)。                               |
| 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。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资范围及投资比例规定。 本基金的标的指数为中证AAA科技创新公司债指数及其未来可能发生的变更。  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和备选成份券,或选择非成份券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差和过2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度、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偏离度、跟踪误差进一步扩大。 本基金运作过程中,当标的指数成份券发生明显负面事件面临停牌或连约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当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;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。  业绩比较基准  中证AAA科技创新公司债指数收益率  本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,再跨标的指数,其风险收益特征与标的指数所   |                    | 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%; 其中投资于标的 |
| 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资范围及投资比例规定。本基金的标的指数为中证AAA科技创新公司债指数及其未来可能发生的变更。  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和备选成份券,或选择非成份券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和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偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中,当标的指数成份券发生明显负面事件面临停牌或选约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当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;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。中证AAA科技创新公司债指数收益率本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所  |                    | 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  |
| 制,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资范围及投资比例规定。 本基金的标的指数为中证AAA科技创新公司债指数及其未来可能发生的变更。  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和备选成份券,或选择非成份券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求目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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和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偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中,当标的指数成份券发生明显负面事件面临停牌或违约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当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;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。  业绩比较基准  中证AAA科技创新公司债指数收益率  本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所   |                    | 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。    |
| 及投资比例规定。     本基金的标的指数为中证AAA科技创新公司债指数及其未来可能发生的变更。     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和备选成份券,或选择非成份券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和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偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中,当标的指数成份券发生明显负面事件面临停牌或违约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当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;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。  业绩比较基准  中证AAA科技创新公司债指数收益率  本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,再预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所   |                    | 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限    |
| 本基金的标的指数为中证AAA科技创新公司债指数及其未来可能发生的变更。  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和备选成份券,或选择非成份券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中,当标的指数成份券发生明显负面事件面临停牌或违约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当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;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。  业绩比较基准  中证AAA科技创新公司债指数收益率  本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所  |                    | 制,基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整本基金的投资范围    |
| 的变更。     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和备选成份券,或选择非成份券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。     在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中,当标的指数成份券发生明显负面事件面临停牌或违约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当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;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。  业绩比较基准  中证AAA科技创新公司债指数收益率  本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所   |                    | 及投资比例规定。                          |
| 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和备选成份券,或选择非成份券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和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偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中,当标的指数成份券发生明显负面事件面临停牌或选约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当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;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。  业绩比较基准  中证AAA科技创新公司债指数收益率  本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。  本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所   |                    | 本基金的标的指数为中证AAA科技创新公司债指数及其未来可能发生   |
| 标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券,或选择非成份券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和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偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中,当标的指数成份券发生明显负面事件面临停牌或造约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当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;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。  业绩比较基准  中证AAA科技创新公司债指数收益率  本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,再于货币市场基金。本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所  |                    | 的变更。                              |
| 伊券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。 在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和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偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中,当标的指数成份券发生明显负面事件面临停牌或违约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当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;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。  业绩比较基准  中证AAA科技创新公司债指数收益率  本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。  本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所   |                    | 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    |
| 理技资策略 主要投资策略 是主要投资策略 是主要投资策略 上进行现金,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中,当标的指数成份券发生明显负面事件面临停牌或违约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当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;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。中证AAA科技创新公司债指数收益率本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所   |                    | 标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券,或选择非成    |
| 在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和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偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中,当标的指数成份券发生明显负面事件面临停牌或造约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当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;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。中证AAA科技创新公司债指数收益率本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所  |                    | 份券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实    |
| <ul> <li></li></ul>  |                    | 现对标的指数的有效跟踪。                      |
| 主要投资策略  《调整或其他因素导致跟踪偏离度和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偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中,当标的指数成份券发生明显负面事件面临停牌或违约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当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;本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。  中证AAA科技创新公司债指数收益率  本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所  |                    | 在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的    |
| 人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 本基金运作过程中,当标的指数成份券发生明显负面事件面临停牌或 违约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当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; 本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。  业绩比较基准  中证AAA科技创新公司债指数收益率  本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。 本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所  |                    | 绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则 |
| 人应米取合埋措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 本基金运作过程中,当标的指数成份券发生明显负面事件面临停牌或 违约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当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; 本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。 中证AAA科技创新公司债指数收益率 本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。 本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所  | <b>十 冊 批 次 ᄷ 凼</b> | 调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理    |
| 违约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当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; 本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。  业绩比较基准  中证AAA科技创新公司债指数收益率  本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。 本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所   | 土安仅页束哈             | 人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。        |
| 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<br>券进行调整;<br>本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货<br>投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。<br>中证AAA科技创新公司债指数收益率<br>本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票<br>型基金、混合型基金,高于货币市场基金。<br>本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所   |                    | 本基金运作过程中, 当标的指数成份券发生明显负面事件面临停牌或   |
| 券进行调整; 本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。  业绩比较基准 中证AAA科技创新公司债指数收益率 本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。 本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所   |                    | 违约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当按照基    |
| 本基金的投资策略主要包括: 抽样复制策略; 替代性策略; 国债期货投资策略; 信用衍生品投资策略; 资产支持证券投资策略。  业绩比较基准  中证AAA科技创新公司债指数收益率  本基金属于债券型基金, 其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金, 高于货币市场基金。 本基金为指数型基金, 跟踪标的指数, 其风险收益特征与标的指数所   |                    | 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    |
| 投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。  业绩比较基准  中证AAA科技创新公司债指数收益率  本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。 本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所  |                    | 券进行调整;                            |
| 业绩比较基准 中证AAA科技创新公司债指数收益率 本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票 型基金、混合型基金,高于货币市场基金。 本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所   |                    | 本基金的投资策略主要包括:抽样复制策略;替代性策略;国债期货    |
| 本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所  |                    | 投资策略;信用衍生品投资策略;资产支持证券投资策略。        |
| <b>风险收益特征</b> 型基金、混合型基金,高于货币市场基金。 本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所   | 业绩比较基准             | 中证AAA科技创新公司债指数收益率                 |
| <b>风险收益特征</b> 本基金为指数型基金,跟踪标的指数,其风险收益特征与标的指数所   |                    | 本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平理论上低于股票    |
| 本基金为指数型基金, 跟踪标的指数, 具风险收益特征与标的指数所   | 团队此头柱红             |                                   |
| 表征的债券市场组合的风险收益特征相似。  | 风险收益特征             | 本基金为指数型基金, 跟踪标的指数, 其风险收益特征与标的指数所  |
|  |                    | 表征的债券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

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)<br>/持有期限(N) | 收费方式/费率 | 备注   |
|------|-------------------------|---------|------|
|      | S < 50 万份               | 0.40%   |      |
| 认购费  | 50万份 ≤ S < 100万份        | 0.20%   |      |
|      | S ≥ 100 万份              | 100 元/笔 | 按笔收取 |

注:场内交易费用以证券公司实际收取为准。

#### 认购费:

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。

#### 申购费:

投资人在申购基金份额时,申购赎回代理券商可按照不超过 0.50%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。

#### 赎回费:

投资人在赎回基金份额时,申购赎回代理券商可按照不超过0.50%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。

### (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<br>或金额(元)                           | 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                                    | 会计师事务所     |
| 信息披露费 | 40,000.00                                    | 规定披露报刊     |
| 其他费用  | 其他按照国家有关<br>规定和《基金合同》<br>约定可以在基金财<br>产中列支的费用 | 相关服务机构     |

注: 1、本基金交易证券等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

2、上表中年费用金额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。

#### 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。

本基金面临的主要风险有市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特有风险、本基金法律文件中涉及基金风险特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险和其他风险等。本基金特有风险包括: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及跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数变更的风险、标的指数值计算出错的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份券停牌的风险、成份券违约的风险、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、基金设额归对价的变现风险、申购赎回清单差错风险、深市成份证券申赎处理规则带来的风险、申购赎回清单标识设置风险、申购赎回的代理买卖风险、操作或技术风险、套利风险、第三方机构服务的风险、投资资产支持证券的风险、投资国债期货的风险、投资信用衍生品的风险等。本基金的一般风险及特有风险详见招募说明书的"风险揭示"部分。

## (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投资价值、市场前景和收益做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,但不保证投资于本基金一定盈利,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。因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议,应经友好协商解决,如经友好协商未能解决的,则任何一方有权按《基金合同》的约定提交仲裁,仲裁机构见《基金合同》。

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

以下资料详见基金管理人网站 www.qtfund.com 或咨询客服电话: 400-888-8688

- 1、基金合同、托管协议、招募说明书及更新
- 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