

招商基金管理有限公司关于招商中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金调整申购赎回现金替代处理规则的公告

为更好地服务投资者，根据相关法律法规、上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则以及《招商中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）《招商中证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》）等有关规定，招商基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）决定自2026年2月12日起调整招商中证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：551900；场内简称：科创债指；扩位证券简称：科创债ETF招商；以下简称“本基金”）申购赎回中现金替代的处理规则，并相应修订《招募说明书》相关条款。具体修订如下：

一、《招商中证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》的修订内容

1、《招募说明书》主要修订内容如下：

章节	原条款内容	修订后条款内容
§ 10 基 金 份额的 申购与 赎回	<p>10.7 申购赎回清单的内容与格式</p> <p>.....</p> <p>3、现金替代相关内容</p> <p>.....</p> <p>（1）可以现金替代</p> <p>1）对于沪市成份证券</p> <p>.....</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布申购现金替代溢价比例，并</p>	<p>10.7 申购赎回清单的内容与格式</p> <p>.....</p> <p>3、现金替代相关内容</p> <p>.....</p> <p>（1）可以现金替代</p> <p>1）对于沪市成份证券</p> <p>.....</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布申购现金替代溢价比例，并</p>

<p>据此收取替代金额。</p> <p>在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 <u>2</u> 个交易日（简称为 T+<u>2</u> 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。基金管理人有权根据替代金额总量、基金投资的需要及市场行情等因素自主决定不买入部分被替代证券，或者不进行任何买入证券的操作，基金管理人可能不买入被替代证券的情形包括但不限于市场流动性不足等市场原因难以成交、技术系统无法实现以及基金管理人认为不应买入的其他情形。T+<u>2</u> 日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照 T+<u>2</u> 日估值全价（即 T+<u>2</u> 日的估值净价与 T+<u>2</u> 日应计利息之和）计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。</p> <p>若现金替代日（T 日）后至 T+<u>2</u> 日期间被替代的证券发生付息等权益变动，则进行相应调整。T+<u>2</u> 日后</p>	<p>据此收取替代金额。</p> <p>在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 <u>1</u> 个交易日（简称为 T+<u>1</u> 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。基金管理人有权根据替代金额总量、基金投资的需要及市场行情等因素自主决定不买入部分被替代证券，或者不进行任何买入证券的操作，基金管理人可能不买入被替代证券的情形包括但不限于市场流动性不足等市场原因难以成交、技术系统无法实现以及基金管理人认为不应买入的其他情形。T+<u>1</u> 日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照 T+<u>1</u> 日估值全价（即 T+<u>1</u> 日的估值净价与 T+<u>1</u> 日应计利息之和）计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。</p> <p>若现金替代日（T 日）后至 T+<u>1</u> 日期间被替代的证券发生付息等权益变动，则进行相应调整。T+<u>1</u> 日后</p>
---	---

<p>第 1 个工作日，基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理机构和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。</p> <p>.....</p> <p>2) 对于深市成份证券</p> <p>.....</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布申购现金替代溢价比例和赎回现金替代折价比例，并据此收取申购替代金额和支付赎回替代金额。</p> <p>对于确认成功的 T 日申购申请和赎回申请，基金管理人根据净申赎规模进行组合证券的代理买入和卖出，T+<u>2</u>日日终，基金管理人根据所购入或卖出的被替代组合证券的实际单位购入成本或实际单位卖出金额、实际购入或卖出的相关费用、申赎轧差部分的被替代组合证券的 T 日估值全价、净申赎部分未买入或未卖出的被替代组合证券的 T+<u>2</u>日估值全价，计算并确定被替代组合证券的单位结算成本，在此基础上根据替代组合证券数量和申购替代金额确定基金应退还现金申购投资者的款项、现金申购投资者应补</p>	<p>第 1 个工作日，基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理机构和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。</p> <p>.....</p> <p>2) 对于深市成份证券</p> <p>.....</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布申购现金替代溢价比例和赎回现金替代折价比例，并据此收取申购替代金额和支付赎回替代金额。</p> <p>对于确认成功的 T 日申购申请和赎回申请，基金管理人根据净申赎规模进行组合证券的代理买入和卖出，T+<u>1</u>日日终，基金管理人根据所购入或卖出的被替代组合证券的实际单位购入成本或实际单位卖出金额、实际购入或卖出的相关费用、申赎轧差部分的被替代组合证券的 T 日估值全价、净申赎部分未买入或未卖出的被替代组合证券的 T+<u>1</u>日估值全价，计算并确定被替代组合证券的单位结算成本，在此基础上根据替代组合证券数量和申购替代金额确定基金应退还现金申购投资者的款项、现金申购投资者应补</p>
---	---

<p>交的款项，根据替代组合证券数量和赎回替代金额确定基金应退还赎回投资者的款项、赎回投资者应补交的款项。</p> <p>若 T 日至 T+2日期间被替代的证券发生付息等权益变动，则进行相应调整。</p> <p>T+2日后第 1 个工作日，基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理机构和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。</p> <p>若发生特殊情况，基金管理人可以对以上交收日期进行相应调整。</p> <p>.....</p> <p>（3）必须现金替代</p> <p>①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证券；或处于停牌的成份证券；或法律法规限制投资的成份证券；或基金管理人出于保护基金份额持有人利益原则等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。</p> <p>.....</p>	<p>交的款项，根据替代组合证券数量和赎回替代金额确定基金应退还赎回投资者的款项、赎回投资者应补交的款项。</p> <p>若 T 日至 T+<u>1</u>日期间被替代的证券发生付息等权益变动，则进行相应调整。</p> <p>T+<u>1</u>日后第 1 个工作日，基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理机构和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。</p> <p>若发生特殊情况，基金管理人可以对以上交收日期进行相应调整。</p> <p>.....</p> <p>（3）必须现金替代</p> <p>①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证券；或处于停牌的成份证券；或法律法规限制投资的成份证券；或基金管理人出于保护基金份额持有人利益原则等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券；<u>或其他可以实行必须现金替代的成份证券。</u></p> <p>.....</p>
---	---

2、《招募说明书》中调整了基金管理人、基金托管人和相关服务机构信息，具体见修订后的《招募说明书》。

二、重要提示

1、基金份额持有人于2026年2月11日15:00前提出的申购赎回申请按照原申购赎回现金替代处理规则办理，基金份额持有人于2026年2月11日15:00后提出的申购赎回申请适用于新的申购赎回现金替代处理规则。

2、本次《招募说明书》的修订已履行适当程序，符合相关法律法规及《基金合同》的规定，对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，《基金合同》当事人权利义务关系也不发生重大变化，根据《基金合同》的规定无需召开基金份额持有人大会。

3、本次修订后的《招募说明书》将自2026年2月12日起生效，并依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。

投资者可通过以下途径咨询有关详情：

招商基金全国统一客户服务热线：400-887-9555

网址：www.cmfchina.com

风险提示：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资产，基金管理人并不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，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，敬请投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》、招募说明书和基金产品资料概要等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。敬请投资者在购买基金前认真考虑、谨慎决策。

特此公告。

招商基金管理有限公司

2026年2月9日