

# 关于南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金变更为南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并修订基金合同、托管协议的公告

南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）基金管理人为南方基金管理股份有限公司（以下简称“本基金管理人”或“本公司”），基金托管人为中信建投证券股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。根据《南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）约定：“若将来基金管理人推出以上证科创板人工智能指数（及其未来可能发生的变更）为标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），基金管理人有权决定将本基金调整为该交易型开放式指数基金（ETF）的联接基金模式并相应修改《基金合同》，届时无需召开基金份额持有人大会，但需履行适当程序并提前公告。”

本公司旗下南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金已于2026年1月16日成立。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《基金合同》的有关规定，本公司经与基金托管人协商一致，决定于2026年2月12日起，将南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金变更为南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，并相应修改《基金合同》和《南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）中相关条款。现将具体事宜公告如下：

## 一、基金份额的变更登记

本基金变更为南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金后，基金的登记机构将进行基金份额变更登记，即将“南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金A类基金份额”变更为“南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金A类基金份额”，“南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金C类基金份额”变更为“南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金C类基金份额”。基金简称分别由“南方上证科创板人工智能指数发起A”变更为“南方上证科创板人工智能ETF发起联接A”，基金代码“025105”不变，“南方上证科创板人工智能指数发起C”变更为“南方上证科创板人工智能ETF发起联接C”，基金代码“025106”不变。

前述变更不影响各类基金份额净值的计算，各类基金份额的申购费率、赎回费率及销售服务费率（如有）均保持不变。

## 二、《基金合同》与《托管协议》的修订

本公司经与基金托管人协商一致，对本基金《基金合同》、《托管协议》中涉及基金变更以及基金实际运作情况等相关内容进行修改。本次系根据《基金合同》的约定进行修改，属于《基金合同》约定的无需召开基金份额持有人大会的情形。修订后的《南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金管理人发起式联接基金基金合同》、《南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金管理人发起式联接基金托管协议》自2026年2月12日起生效，原《基金合同》和《托管协议》自同日起失效。

本基金管理人将于公告当日将修改后的《南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金管理人发起式联接基金基金合同》和《南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金管理人发起式联接基金托管协议》登载于规定网站。本基金招募说明书及基金产品资料概要涉及前述内容的，将一并修改，并依照《公开募集证券投资基金管理信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 三、其他需要提示的事项

1、本公告仅对南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金管理人变更为南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金管理人发起式联接基金并修改《基金合同》和《托管协议》事项予以说明。投资者欲了解基金信息，请仔细阅读本基金的《基金合同》等相关法律文件。本基金管理人可以在法律法规和《基金合同》规定范围内调整上述有关内容。

2、投资人可以登录本公司网站（[www.nffund.com](http://www.nffund.com)）或拨打客户服务电话（400-889-8899）咨询相关信息。

**风险提示：**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。投资有风险，敬请投资者在投资基金前认真阅读基金的相关法律文件及关注基金特有风险，了解基金的风险收益特征，并根据自身的风险承受能力选择适合自己的基金产品。

特此公告。

南方基金管理股份有限公司

2026年2月9日

**附件：《南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金基金合同》**  
**修订前后对照表**

| 章节      | 修订前表述   | 修订后表述  |
|---------|---|--|
| 全文      | 南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金  | 南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金   |
| 第一部 分前言 | <p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）和其他有关法律法规。</p> | <p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》（以下简称“《指数基金指引》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第2号——基金中基金指引》和其他有关法律法规。</p> |
|         | <p>三、南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。</p> <p>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和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。</p>  | <p>三、南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金由南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金变更而来。南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、《南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金基金合同》及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）注册。</p> <p>中国证监会对南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。</p>  |
| 第二部 分释义 | <p>8、基金份额发售公告：指《南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金基金份额发售公告》</p> <p>24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定投等业务</p> <p>30、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向</p>  | <p>23、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定投等业务</p> <p>29、基金合同生效日：指《南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式</p>  |

|            |  |   |
|------------|--|---|
|            | <p>中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期</p> <p>32、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过 3 个月</p> <p>33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限</p> <p>40、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同、招募说明书和相关公告的规定申请购买基金份额的行为</p> <p>49、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和</p> <p>55、A类基金份额：指在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用并在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额</p> <p>56、C类基金份额：指从本类别基金资产净值中计提销售服务费，不收取认购/申购费用并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额</p> <p>60、发起资金：指基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或者基金经理等人员参与认购的资金。发起资金认购本基金的金额不低于 1000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不低于三年</p> <p>61、发起资金提供方：指以发起资金认购本基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年的基金管理人股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员</p> | <p>联接基金基金合同》生效日，原《南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金基金合同》自同一起失效</p> <p>31、存续期：指《南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金基金合同》生效至本基金合同终止之间的不定期期限</p> <p>46、基金资产总值：指基金拥有的目标 ETF 基金份额、各类有价证券及票据价值、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和</p> <p>52、A类基金份额：指在投资人申购时收取前端申购费用并在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额</p> <p>53、C类基金份额：指从本类别基金资产净值中计提销售服务费，不收取申购费用并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额</p> <p>57、发起资金：指基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或者基金经理等人员参与认购的资金。发起资金认购南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金的金额不低于 1000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不低于三年</p> <p>58、发起资金提供方：指以发起资金认购南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金且承诺以发起资金认购的基金份额持有期限不少于三年的基金管理人股东、基金管理人、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员</p> <p>64、交易型开放式证券投资基金：指《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》定义的“交易型开放式证券投资基金”，简称 ETF</p> <p>65、ETF 联接基金：指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的 ETF（以下简称目标 ETF），紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金，简称联接基金</p> |
| 第三部分<br>基金 | <p>二、基金的类别</p> <p>股票型证券投资基金</p> <p>四、基金的投资目标</p>   | <p>二、基金的类别</p> <p>ETF 联接基金</p> <p>四、基金的投资目标</p>   |

|           |   |   |
|-----------|---|---|
| 的 基 本 情 况 | 本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。  | 本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。   |
|           | 五、基金的最低募集份额总额和金额<br>本基金为发起式基金，最低募集份额总额为1000万份，基金募集金额不少于1000万元人民币。其中，发起资金提供方认购本基金的总金额不少于1000万元人民币，且持有期限不少于3年，法律法规和监管机构另有规定的除外。 | 五、发起资金的认购<br>发起资金提供方认购南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金的总金额不少于1000万元人民币，且持有期限自《南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金基金合同》生效日起不少于3年，法律法规和监管机构另有规定的除外。  |
|           | 六、首次募集规模上限<br>本基金可设置首次募集规模上限，具体募集上限及规模控制的方案详见招募说明书、基金份额发售公告或其他公告。若本基金设置首次募集规模上限，基金合同生效后不受此募集规模的限制。                            |   |
|           | 七、基金份额发售面值和认购费用<br>本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。本基金具体认购费率按招募说明书及基金产品资料概要的规定执行。  | 六、基金份额面值<br>本基金基金份额面值为人民币1.00元。   |
|           |   | 九、目标 ETF 及联接基金的联系与区别<br>本基金的目标 ETF 为南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金。<br>1、本基金为目标 ETF 的联接基金，二者既有联系也有区别：<br>（1）在投资方法方面，目标 ETF 主要采取完全复制法，直接投资于标的指数的成份股、备选成份股；而本基金则采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于目标 ETF，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。<br>（2）在交易方式方面，投资人既可以在二级市场买卖目标 ETF，也可以按照申购赎回清单的要求，采用份额申购和份额赎回的方式申购目标 ETF 或者按照目标 ETF 法律文件的约定以其他方式申购目标 ETF；而本基金的申购与赎回则与普通的开放式基金类似，通过基金管理人及销售机构按未知价法采用金额申购、份额赎回的方式进行。<br>（3）价格揭示机制不同。目标 ETF 有实时市场价格和每日净值；本基金只揭示每日基金净值。<br>（4）申购赎回方式不同。目标 ETF 的投资人依据申购赎回清单，按以组合证券为主的申购对价、赎回对价进行申购赎回，申购赎回均以份额申报或者按照目标 ETF 法律文件的约定以其 |

|   |   |   |
|---|---|---|
|   |   | <p>他方式申赎目标 ETF；本基金的投资人依据基金份额净值，以现金方式进行申购赎回，金额申购、份额赎回。</p> <p>2、本基金与目标 ETF 业绩表现可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括：</p> <p>（1）法律法规对投资比例的要求。目标 ETF 作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，每个交易日日终在扣除金融衍生品合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。</p> <p>（2）申购赎回的影响。目标 ETF 采取实物申购的方式或者按照目标 ETF 法律文件的约定以其他方式申赎目标 ETF，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金申购赎回采用现金方式，大额申购可能会对基金净值产生一定冲击。</p> <p>（3）投资管理方式的不同，如在指数化投资过程中，不同的管理方式会导致跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等的不同。</p> |
|   | <p><b>十、基金份额的类别</b></p> <p>本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用并在赎回时根据持有期限收取赎回费用、且不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产净值中计提销售服务费、不收取认购/申购费用并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。</p> | <p><b>十、基金份额的类别</b></p> <p>本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取前端申购费用并在赎回时根据持有期限收取赎回费用、且不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产净值中计提销售服务费、不收取申购费用并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。</p>   |
|   | <p><b>十一、未来条件许可情况下的基金模式转换</b></p> <p>若将来基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后有权决定将本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改《基金合同》。此项调整需经基金管理人与基金托管人协商一致，并依照《信息披露办法》的有关规定公告，但不需召开基金份额持有人大会审议。</p>                              |   |
| 第四部分 基金份额的发售<br>一、基金份额的发售时间、发售方式、发售对象<br>1、发售时间<br>自基金份额发售之日起最长不得超过 3 个月， |   | <p><b>第四部分 基金的历史沿革</b></p> <p>南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金由南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金变更而来。南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金</p>  |

|   |  |   |
|---|--|---|
| 革 | <p>具体发售时间见基金份额发售公告。</p> <p><b>2、发售方式</b></p> <p>通过各销售机构的基金销售网点或按基金管理人、销售机构提供的其他方式公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告及基金管理人网站。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构。</p> <p><b>3、发售对象</b></p> <p>符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者、发起资金提供方以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。</p> <p><b>二、基金份额的认购</b></p> <p><b>1、发起资金认购</b></p> <p>本基金发起资金认购的金额不少于 1000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。其中发起资金指基金管理人的股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员或基金经理等人员参与认购的资金。</p> <p>本基金发起资金的认购情况见基金管理人届时发布的公告。</p> <p><b>2、认购费用</b></p> <p>本基金 A 类基金份额在认购时收取基金前端认购费用；C 类基金份额不收取认购费用。本基金 A 类基金份额的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。基金认购费用不列入基金财产。</p> <p><b>3、募集期利息的处理方式</b></p> <p>有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的数额以登记机构的记录为准。</p> <p><b>4、基金认购份额的计算</b></p> <p>基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。</p> <p><b>5、认购份额余额的处理方式</b></p> <p>认购份额余额的处理方式在招募说明书中列示。</p> <p><b>6、认购申请的确认</b></p> <p>销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构已经接收到认购申请。认购申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。</p> | <p>基金经中国证监会 2025 年 6 月 19 日证监许可〔2025〕1290 号文注册募集，《南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金基金合同》于 2025 年 9 月 16 日生效。基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为中信建投证券股份有限公司。</p> <p>根据《南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金基金合同》的约定：“若将来基金管理人推出以上证科创板人工智能指数（及其未来可能发生的变更）为标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），基金管理人有权决定将本基金调整为该交易型开放式指数基金（ETF）的联接基金模式并相应修改《基金合同》，届时无需召开基金份额持有人大会，但需履行适当程序并提前公告。”基金管理人在履行适当程序后决定将南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金变更为南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，并相应修改《南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金基金合同》。</p> <p>自 2026 年 2 月 12 日起，南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金变更为南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，《南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金基金合同》失效，《南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》自该日起生效。本基金合同当事人将按照《南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》享有相应权利并承担有关义务。</p> |
|---|--|---|

|            |   |   |
|------------|---|---|
|            | <p>三、基金份额认购金额的限制</p> <p>1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。</p> <p>2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书或相关公告。</p> <p>3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。</p>  |   |
| 第五部分 基金的存续 | <p>第五部分 基金备案</p> <p>一、基金备案的条件</p> <p>本基金自基金份额发售之日起3个月内，在发起资金提供方使用发起资金认购本基金的金额不少于1000万元，且发起资金提供方承诺认购的基金份额持有期限不少于3年的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，验资报告需对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明。基金管理人自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。</p> <p>基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。</p> | 第五部分 基金的存续  |
|            | <p>二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式</p> <p>如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：</p> <p>1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；</p> <p>2、在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；</p> <p>3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。</p>   |   |
|            | <p>三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p> <p>《基金合同》生效之日起3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，且不得通过召开基金份额持有人大会延续</p>   | 《南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金基金合同》生效之日起3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，且不得通过召开基金份额持有人大会延续 |

|  |   |  |
|--|---|--|
|  | <p>且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。</p> <p>如本基金在《基金合同》生效 3 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，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。</p>   | <p>基金合同期限。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。</p> <p>如本基金在《南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金基金合同》生效 3 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，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。</p>  |
| 第六部分<br>基<br>金<br>份<br>额<br>的<br>申<br>购<br>与<br>赎<br>回 | <p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>基金管理人可根据实际情况依法决定本基金开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。</p> <p>基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个<br/>月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开<br/>始公告中规定。</p>   | <p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p>   |
|  | <p>三、申购与赎回的原则</p> <p>4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人<br/>认购、申购的先后次序进行顺序赎回；</p>  | <p>三、申购与赎回的原则</p> <p>4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人<br/>申购的先后次序进行顺序赎回；</p>  |
|  | <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接<br/>受投资人的申购申请：</p> <p>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可<br/>能导致单一投资者（基金管理人、基金管理人<br/>高级管理人员或基金经理作为发起资金提供方<br/>除外）持有基金份额的比例达到或者超过 50%，<br/>或者变相规避 50%集中度的情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、8、10 项暂停申购<br/>情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申<br/>购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规<br/>定媒介上刊登暂停申购公告。当发生上述第 7、<br/>9 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等<br/>方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管<br/>理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如<br/>果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被拒</p> | <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接<br/>受投资人的申购申请：</p> <p>7、目标 ETF 暂停基金资产估值，导致基金管理<br/>人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>8、目标 ETF 暂停申购、暂停上市或二级市场交<br/>易停牌、达到或接近申购上限，基金管理人认<br/>为有必要暂停本基金申购的情形。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7、8、9、11 项暂<br/>停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投<br/>资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规<br/>定在规定媒介上刊登暂停申购公告。当发生上<br/>述第 10 项情形时，基金管理人可以采取比例确<br/>认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基<br/>金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。<br/>如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被</p> |

|   |  |  |
|---|--|--|
|   | <p>绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形<br/>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p>   | <p>拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形<br/>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> <p>7、目标 ETF 暂停基金资产估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</p> <p>8、目标 ETF 暂停赎回、暂停上市或二级市场交易停牌或延缓支付赎回对价，基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的情形。</p>  |
| <p>第七部分<br/>基金管理人<br/>合<br/>同<br/>当<br/>事<br/>人<br/>及<br/>权<br/>利<br/>义<br/>务</p> | <p>一、基金管理人<br/>(二) 基金管理人的权利与义务<br/>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：<br/>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管和定投等业务规则；</p> <p>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：<br/>(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；<br/>(8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并披露基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；<br/>(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；</p> | <p>一、基金管理人<br/>(二) 基金管理人的权利与义务<br/>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：<br/>(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管和定投等业务规则；<br/>(18)经与基金托管人协商一致，代表基金份额持有人的利益行使因基金财产投资于目标 ETF 所产生的权利；<br/>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：<br/>(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申购、赎回和登记事宜；<br/>(8)采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并披露基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；</p> |
|   | <p>三、基金份额持有人<br/>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：</p> <p>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：<br/>(4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和</p>  | <p>三、基金份额持有人<br/>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：<br/>(6)出席或者委派代表出席目标 ETF 基金份额持有人大会，对目标 ETF 基金份额持有人大会审议事项行使表决权；<br/>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：<br/>(4) 缴纳基金申购款项及法律法规和《基金合</p>  |

|                   |  |  |
|-------------------|--|--|
|                   | 《基金合同》所规定的费用;  | 同》所规定的费用;  |
| 第八部分<br>基金份额持有人大会 |  | <p>本基金是目标 ETF 的联接基金，鉴于本基金和目标 ETF 的相关性，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额出席或者委派代表出席目标 ETF 基金份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，本基金的基金份额持有人持有的享有表决权的参会份额数和表决票数为：在目标 ETF 基金份额持有人大会的权益登记日，本基金持有目标 ETF 基金份额的总数乘以该持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。本基金份额折算为目标 ETF 后的每一参会份额和目标 ETF 的每一参会份额拥有平等的投票权。</p> <p>本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标 ETF 的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决。</p> <p>本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的，须先遵照本基金《基金合同》的约定召开本基金的基金份额持有人大会，本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的，由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会。</p> |
|                   | <p>一、召开事由</p> <p>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的除外：</p> <p>(8) 变更基金投资目标、范围或策略；</p> <p>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：</p> | <p>一、召开事由</p> <p>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的除外：</p> <p>(8) 变更基金投资目标、范围或策略，但由于目标 ETF 标的指数变更、交易方式变更、终止上市或目标 ETF 基金合同终止而变更本基金投资目标、范围或策略的情况除外；</p> <p>(13) 基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会；</p> <p>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：</p>  |

|                            |   |   |
|----------------------------|---|---|
|                            | <p>(4) 调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管、定投等业务的规则；</p>  | <p>(4) 调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管、定投等业务的规则；</p> <p>(7) 本基金采取特殊申购或其他方式参与目标 ETF 的申购赎回；</p> <p>(9) 由于目标 ETF 标的指数变更、交易方式变更、终止上市或目标 ETF 基金合同终止而变更本基金投资目标、范围或策略；</p>  |
| 第十<br>二部<br>分基<br>金的<br>投资 | <p><b>一、投资目标</b><br/>本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。</p> <p><b>二、投资范围</b><br/>本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票、存托凭证）、金融衍生品（股指期货、股票期权等）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、政府机构债券、地方政府债券、次级债、可转换债券、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、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具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）。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于股票（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除金融衍生品合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。</p> | <p><b>一、投资目标</b><br/>本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。</p> <p><b>二、投资范围</b><br/>本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票、存托凭证）、金融衍生品（股指期货、股票期权等）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、政府机构债券、地方政府债券、次级债、可转换债券、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、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具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）。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。每个交易日日终在扣除金融衍生品合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。</p> |

|   |  |
|---|--|
| <p><b>三、投资策略</b></p> <p>本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因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。</p> <p><b>(一) 资产配置策略</b></p> <p>为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将主要投资于标的指数成份股和备选成份股。原则上本基金将采用完全复制法，按标的指数的成份股权重构建组合。特殊情况下，本基金将配合使用优化方法作为补充，以保证对标的指数的有效跟踪。</p> <p><b>(二) 股票投资策略</b></p> <p>本基金原则上通过完全复制法进行被动式指数化投资，根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。</p> <p><b>1、股票投资组合的构建</b></p> <p>本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。特殊情况下，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对基金资产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。</p> <p><b>2、股票投资组合的调整</b></p> <p><b>(1) 定期调整</b></p> <p>本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的跟踪调整。</p> | <p><b>三、投资策略</b></p> <p>本基金为完全被动式指数基金，主要投资于目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。在正常市场情况下，本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因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。</p> <p><b>(一) 资产配置策略</b></p> <p>为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90%的资产投资于目标 ETF。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、股票期权等以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。</p> |
|---|--|

|        |   |  |
|--------|---|--|
|        | <p>(2) 不定期调整</p> <p>1)当成份股发生增发、送配等情况而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据指数公司发布的临时调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整；</p> <p>2)根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数；</p> <p>3)特殊情况下，如基金管理人无法按照其所占标的指数权重进行购买时，基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资人利益，决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。</p> <p>上述特殊情况包括但不限于以下情形：①法律法规的限制；②标的指数成份股长期停牌；③标的指数成份股流动性严重不足；④成份股上市公司存在重大违规行为，有可能面临重大的处罚或诉讼。</p> <p>本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，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股进行调整。</p> |  |
| 四、投资限制 | 四、投资限制  |  |

|  |   |
|--|---|
| <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1) 本基金投资于股票（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；</p> <p>除上述第（2）、（7）、（9）、（10）、（14）项另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制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，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>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：</p> <p>(4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</p> | <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1) 本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；</p> <p>因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第（1）项规定投资比例的，基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外；除上述第（1）、（2）、（7）、（9）、（10）、（14）项另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标 ETF 暂停申购、赎回或二级市场交易停牌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，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>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：</p> <p>(4) 买卖除目标 ETF 以外的其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；</p> |
| <p>五、标的指数和业绩比较基准</p> <p>本基金投资于股票（含存托凭证）的资产比例不低于基金资产的 90%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除金融衍生品合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。业绩比较基准与投资比例相符。</p> <p>未来若出现标的指数不符合要求（因成份股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，本基</p>                 | <p>五、标的指数和业绩比较基准</p> <p>本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。每个交易日日终在扣除金融衍生品合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。业绩比较基准与投资比例相符。</p> <p>未来若出现标的指数不符合要求（因成份股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，本基</p>   |

|  |   |  |
|--|---|--|
|  | <p>金合同终止。</p>   | <p>金合同终止，但下文“八、目标 ETF 发生相关变更情形时的处理”另有约定的除外。</p>  |
|  | <p><b>六、风险收益特征</b></p> <p>本基金属于股票型基金，一般而言，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。本基金投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括股价波动风险、流动性风险、退市风险和投资集中风险等。</p>  | <p><b>六、风险收益特征</b></p> <p>本基金的目标 ETF 为股票型基金，一般而言，其长期平均风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。本基金投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括股价波动风险、流动性风险、退市风险和投资集中风险等。</p>   |
|  | <p><b>八、基金的投资模式变更</b></p> <p>若将来基金管理人推出以上证科创板人工智能指数（及其未来可能发生的变更）为标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），基金管理人有权决定将本基金调整为该交易型开放式指数基金（ETF）的联接基金模式并相应修改《基金合同》，届时无需召开基金份额持有人大会，但需履行适当程序并提前公告。</p> <p>联接基金是指其绝大部分基金资产投资于同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），以紧密跟踪标的指数为目的的指数化产品。</p> | <p><b>八、目标 ETF 发生相关变更情形时的处理</b></p> <p>目标 ETF 出现下述情形之一的，本基金将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会；若届时基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资人合法权益的原则，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，本基金基金合同中将删除关于目标 ETF 的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。</p> <p>1、目标 ETF 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；<br/> 2、目标 ETF 终止上市；<br/> 3、目标 ETF 基金合同终止；<br/> 4、目标 ETF 的基金管理人发生变更（但变更后的本基金与目标 ETF 的基金管理人相同的除外）。</p> <p>若目标 ETF 变更标的指数，本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标 ETF。但目标 ETF 召开基金份额持有人大会审议变更目标 ETF 标的指数事项的，本基金的基金份额持有人可出席目标 ETF 基金份额持有人大会并进行表决，目标 ETF 基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的，本基金可不召开基金份额持有人大会相应变更标的指数并仍为该目标 ETF 的联接基金。</p> |

|               |  |  |
|---------------|--|--|
| 第十三部分 基金的财产   | 一、基金资产总值<br>基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。                                  | 一、基金资产总值<br>基金资产总值是指基金拥有的目标 ETF 基金份额、各类有价证券及票据价值、银行存款本息、基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。  |
| 第十四部分 基金资产估值  | 二、估值对象<br>基金所拥有的股票、债券、银行存款本息、应收款项、金融衍生品、资产支持证券和其他投资等资产及负债。   | 二、估值对象<br>基金所拥有的目标 ETF 基金份额、股票、债券、银行存款本息、应收款项、金融衍生品、资产支持证券和其他投资等资产及负债。   |
|               | 四、估值方法   | 四、估值方法<br>1、目标 ETF 的估值<br>本基金投资的目标 ETF 份额以其估值日基金份额净值估值，如该日目标 ETF 未公布净值，则按目标 ETF 最近公布的净值估值。   |
|               | 七、暂停估值的情形  | 七、暂停估值的情形<br>2、基金所投资的目标 ETF 发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；  |
|               | 九、特殊情况的处理<br>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。  | 九、特殊情况的处理<br>1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 9 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。  |
| 第十五部分 基金费用与税收 | 一、基金费用的种类  | 一、基金费用的种类<br>11、基金投资目标 ETF 的相关费用（包括但不限于目标 ETF 的交易费用、申赎费用等）；  |
|               | 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式<br>1、基金管理人的管理费<br>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：<br><br>E 为前一日的基金资产净值 | 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式<br>1、基金管理人的管理费<br>本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：<br>E 为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则 E 取 0） |
|               | 2、基金托管人的托管费<br>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：<br><br>E 为前一日的基金资产净值                        | 2、基金托管人的托管费<br>本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则取 0）的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：<br>E 为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有目标 ETF 基金份额部分基金资产后的余额（若为负数，则 E 取 0）                        |
|               | 上述“一、基金费用的种类”中第 4-11 项费用，  | 上述“一、基金费用的种类”中第 4-12 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。   | 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<br>下列费用不列入基金费用：<br>3、《基金合同》生效前的相关费用；   | 三、不列入基金费用的项目<br>下列费用不列入基金费用：<br>3、《南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金基金合同》生效前的相关费用；  |
| 第十六部分 基金的收益与分配 | 三、基金收益分配原则<br>1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以届时基金管理人发布的公告为准。若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；   | 三、基金收益分配原则<br>1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以届时基金管理人发布的公告为准；   |
| 第十七部分 基金的会计与审计 | 一、基金会计政策<br>2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；  | 一、基金会计政策<br>2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；  |
| 第十八部分 基金的信息披露  | 五、公开披露的基金信息<br>公开披露的基金信息包括：<br>(一)基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要<br>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。<br>基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和《基金合同》提示性公告登载在规定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在网站 | 五、公开披露的基金信息<br>公开披露的基金信息包括：<br>(一)基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要<br>2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。 |

|                |  |   |
|----------------|--|---|
|                | <p>上。</p> <p><b>(二) 基金份额发售公告</b><br/>基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于规定媒介上。</p> <p><b>(三) 《基金合同》生效公告</b><br/>基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定媒介上登载《基金合同》生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况及基金管理人、基金管理人高级管理人员、基金经理等人员以及基金管理人股东持有的基金份额、承诺持有的期限等情况。</p> <p><b>(六) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告</b><br/>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。</p> <p><b>(七) 临时报告</b><br/>前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：</p> <p>8、基金募集期延长或提前结束募集；</p> | <p><b>(四) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告</b></p> <p><b>(五) 临时报告</b><br/>前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：</p> <p>23、目标 ETF 变更；</p> <p><b>(十三) 投资目标 ETF 的信息披露</b><br/>本基金在定期报告和招募说明书（更新）中应设立专门章节披露所持目标 ETF 的相关情况并揭示相关风险：</p> <p>1、投资政策、持仓情况、损益情况、净值披露时间等；</p> <p>2、交易及持有目标 ETF 产生的费用，包括申购费、赎回费、销售服务费、管理费、托管费等，在招募说明书（更新）中列明计算方法并举例说明；</p> <p>3、持有的目标 ETF 发生的重大影响事件，如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等；</p> <p>4、本基金投资于基金管理人以及基金管理人关联方所管理基金的情况。</p> |
| 第二十二部分 基金合同的效力 | 1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或签章并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。   | 1、本基金由南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金变更而来，《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或签章，自 2026 年 2 月 12 日起生效，原《南方上证科创板人工智能指数发起式证券投资基金基金合同》自同一日   |

|   |  |      |
|---|--|------|
| 力 |  | 起失效。 |
|---|--|------|

注：本基金基金合同摘要涉及以上修改之处也进行了相应修改。修订后的条款以本公司发布的《南方上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》为准。