嘉实中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：东方财富证券股份有限公司

二〇二六年十一月

重要提示

本基金经2026年8月28日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予嘉实中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2026〕2382号）注册募集。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但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作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。投资者认购或申购基金份额时应认真阅读本招募说明书。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

本基金属于股票型基金，一般情况下，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。

本基金的投资范围包含股指期货、股票期权、国债期货等金融衍生品、资产支持证券等品种，并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，可能给本基金带来额外风险。本基金可能投资于金融衍生品，金融衍生品投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动等风险。

本基金的投资范围包括存托凭证，如投资存托凭证的，除与其他仅投资于境内市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险。

本基金投资于科创板股票，将面临流动性风险、退市风险、投资集中度风险，详见本基金招募说明书“风险揭示”章节。

本基金投资于创业板股票，将面临创业板上市公司盈利不及预期风险、退市风险、股价大幅波动风险、红筹企业及存托凭证相关风险等，详见本基金招募说明书“风险揭示”章节。

本基金为指数基金，投资者投资于本基金可能面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编

制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书“风险揭示”章节。

本基金标的指数为中证人工智能主题指数（指数代码 930713）。中证人工智能主题指数选取 50 只业务涉及为人工智能提供基础资源、技术以及应用支持的上市公司证券作为指数样本，以反映人工智能主题上市公司证券的整体表现。

中证人工智能主题指数的样本空间的构成方法：

1、样本空间

同中证全指指数的样本空间

2、可投资性筛选

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前 80%。

3、选样方法

（1）对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，选取业务涉及大数据、云计算、云存储、机器学习、机器视觉、人脸识别、语音语义识别、智能芯片等领域的上市公司证券作为待选样本；

（2）在上述待选样本中，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名前 50 的证券作为指数样本。

4、指数计算

指数计算公式为：

报告期指数 = 报告期样本的调整市值/除数 × 1000

其中，调整市值＝ ∑(证券价格×调整股本数×权重因子)。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子介于 0 和 1 之间，以使单个样本权重不超过 10%。

5、指数样本和权重调整

（1）定期调整

指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别为每年 6 月和 12 月的第二个星期五的下一交易日。

权重因子随样本定期调整而调整，调整时间与指数样本定期调整实施时间相同。在下一个定期调整日前，权重因子一般固定不变。

（2）临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站，网址：

https://www.csindex.com.cn/。

投资者投资本基金时需具有深圳证券账户，但需注意，使用深圳证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资者需要使用本基金标的指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应开立深圳证券交易所A股账户；如投资者需要使用本基金标的指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立上海证券交易所A股账户。

投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同和基金产品资料概要，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人承诺以恪尽职守、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，也不向投资者保证最低收益或投资本金不受损失。

基金管理人深知个人信息对投资者的重要性，致力于投资者个人信息的保护。基金管理人承诺按照法律法规和相关监管要求的规定处理投资者的个人信息，包括通过基金管理人直销、销售机构或场内经纪机构购买嘉实基金管理有限公司旗下基金产品的所有个人投资者。基金管理人需处理的机构投资者信息中可能涉及其法定代表人、受益所有人、经办人等个人信息，也将遵守上述承诺进行处理。详情请关注嘉实基金官网（http://www.jsfund.cn/main/include/privacy/index.shtml）披露的“嘉实基金隐私政策”及其后续作出的不时修订。

目 录

一、绪 言 1
二、释 义 2
三、基金管理人 7
四、基金托管人 17
五、相关服务机构 20
六、基金的募集 22
七、基金合同的生效 31
八、基金份额的上市交易 32
九、基金份额的申购、赎回 34
十、基金的投资 48
十一、基金的财产 56
十二、基金资产估值 57
十三、基金的收益与分配 62
十四、基金的费用与税收 63
十五、基金的会计与审计 65
十六、基金的信息披露 66
十七、风险揭示 72
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 81
十九、基金合同内容摘要 83
二十、基金托管协议的内容摘要 98
二十一、对基金份额持有人的服务 113
二十二、其他应披露事项 117
二十三、招募说明书存放及查阅方式 118
二十四、备查文件 119

一、绪 言

本招募说明书依据《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》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号<招募说明书的内容与格式>》等有关法律法规以及《嘉实中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。如本招募说明书内容与基金合同有冲突或不一致之处，均以基金合同为准。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，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

二、释 义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语有如下含义：

1、基金/本基金：指嘉实中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金

2、基金管理人：指嘉实基金管理有限公司

3、基金托管人：指东方财富证券股份有限公司

4、基金合同：指《嘉实中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《嘉实中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书：指《嘉实中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新

7、基金产品资料概要：指《嘉实中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

8、基金份额发售公告：指《嘉实中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》

9、基金份额上市交易公告书：指《嘉实中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金基金份额上市交易公告书》

10、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、司法解释、行政规章、规范性文件以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等，包括颁布机关对前述文件不时做出的修订

11、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改<中华人民共和国港口法>等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修订的《公开募集证

券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

14、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

15、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

16、业务规则：指深圳证券交易所发布实施的《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》及其不时修订的版本、中国证券登记结算有限责任公司发布实施的《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》及其不时修订的版本，以及基金管理人、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司发布及其不时修订的其他相关规则、规定、通知及指南等

17、交易型开放式指数证券投资基金：指《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》定义的“交易型开放式基金”，简称 ETF

18、ETF 联接基金：指将绝大多数基金财产投资于本基金，与本基金的投资目标类似，通过投资于本基金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 ETF 联接

19、《指数基金指引》：指中国证监会 2021 年 1 月 22 日颁布、同年 2 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》及颁布机关对其不时做出的修订

20、中国：指中华人民共和国(仅为基金合同目的不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)

21、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

22、证券交易所：指根据法律法规的规定，由国家决定或批准设立的证券交易场所

23、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

24、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

25、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

26、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定可以使用来自境外的资金投资于在中国境内依

法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

27、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外投资者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的合称

28、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

29、销售机构：指基金管理人以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得公开募集证券投资基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构，包括发售代理机构和申购赎回代理券商

30、发售代理机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的代理本基金发售业务的机构

31、申购、赎回代理券商：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，由基金管理人指定的办理本基金申购、赎回业务的证券公司，又称为代办证券公司

32、登记机构/登记结算机构：指办理登记结算业务的机构。本基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

33、登记结算业务：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》及其不时修订以及相关业务规则定义的基金份额的登记、存管、结算及相关业务

34、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理完毕基金备案手续，并获得中国证监会书面确认的日期

35、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

36、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

37、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

38、工作日：同交易日，指上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所的正常交易之日

39、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

40、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

41、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

42、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

43、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同、招募说明书及相关公告的规定申请购买基金份额的行为

44、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书及相关公告的规定，以申购赎回清单规定的申购对价申请购买基金份额的行为

45、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同、招募说明书及相关公告规定的条件要求将基金份额兑换为申购赎回清单规定的赎回对价的行为

46、申购赎回清单：指由基金管理人编制的用以公告申购对价、赎回对价等信息的文件

47、申购对价：指投资人申购基金份额时，按基金合同和招募说明书规定应交付的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价

48、赎回对价：指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人按基金合同和招募说明书规定应交付给赎回申请人的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价

49、组合证券：指本基金标的指数所包含的全部或部分证券

50、标的指数：指中证人工智能主题指数及其未来可能发生的变更

51、完全复制法：指一种构建跟踪指数的投资组合的方法。通过购买标的指数中的所有成份证券，并且按照每种成份证券在标的指数中的权重确定购买的比例，以达到复制指数的目的

52、现金替代：指申购或赎回过程中，投资人按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中全部或部分证券的一定数量的现金

53、现金替代退补款：指投资人支付的现金替代与基金购入被替代成份证券的成本及相关费用的差额。若现金替代大于本基金购入被替代成份证券的成本及相关费用，则本基金需向投资人退还差额，若现金替代小于本基金购入被替代成份证券的成本及相关费用，则投资人需向本基金补缴差额

54、现金差额：指最小申购赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差；投资人申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算

55、最小申购赎回单位：指本基金申购份额、赎回份额的最低数量，投资人申购、赎回的基金份额数应为最小申购赎回单位的整数倍

56、基金份额参考净值：指基金管理人或基金管理人委托的其他机构在相关证券交易所交易时间内根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据计算并发布的基金份额参考净值，简称 IOPV

57、预估现金差额：指由基金管理人计算并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额的预估值，预估现金差额由申购赎回代理券商（代办证券公司）预先冻结

58、元：指人民币元

59、基金份额折算：指基金管理人根据基金运作的需要，在基金资产净值不变的前提下，按照一定比例调整基金份额总额及基金份额净值的行为

60、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

61、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

62、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

63、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

64、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

65、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

66、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

67、转融通证券出借业务：简称出借业务，是指本基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称证券金融公司）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务

68、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层
法定代表人	经雷
成立日期	1999 年 3 月 25 日
注册资本	1.5 亿元
股权结构	中诚信托有限责任公司 40%，DWS Investments Singapore Limited 30%，立信投资有限责任公司 30%。
存续期间	持续经营
电话	（010）65215588
传真	（010）65185678
联系人	罗朝伟

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 和特定资产管理业务等资格。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

安国勇先生，董事长，博士研究生，中共党员。曾任中国人民财产保险股份有限公司船舶货运保险部总经理，华夏银行副行长（挂职），中国人保资产管理有限公司党委委员、副总裁，中诚信托有限责任公司党委书记、总裁。

王会妙女士，董事，北京大学经济学博士。曾就职于河北定州师范学院、国投信托有限责任公司。2011 年 5 月加入中诚信托有限责任公司，曾任信托业务总部业务团队负责人（MD）、信托业务三部总经理、财富管理中心副总经理、资产配置部总经理、中诚资本管理（北京）有限公司总经理等职，现任中诚信托有限责任公司党委副书记、总裁。

Markus Johann Kobler 先生，董事，瑞士、英国及德国国籍。毕业于瑞士巴塞尔大学（University of Basel），获经济学博士学位。加入 DWS Group 前，Markus Johann Kobler 先生于 1993 年至 2023 年期间先后担任学术研究、管理咨询、金融服务及高级管理职务，曾任职于瑞士巴塞尔大学（University of Basel）、麦肯锡公司（McKinsey & Company）、瑞士宝盛银行（Bank Julius Baer & Co. AG）及安联环球投资（Allianz Global Investors）等机构。Markus Johann Kobler 先生于 2023 年 11 月加入 DWS Group，目前担任管理委员会成员（Member of the Management Board）、首席财务官（Chief Financial Officer）及首席财务官部门负责人（Head of the CFO Division）。

沈铠圻（Heidi Sum）女士，董事，中国香港籍，毕业于香港大学，获工学学士学位，并持有特许金融分析师（CFA）资格及英国皇家特许测量师学会会员（MRICS）资格。沈铠圻女士拥有逾二十年亚太及全球资产管理、房地产投资及实物资产投资经验。加入 DWS Group 前，曾于新鸿基地产发展有限公司、领盛投资管理公司（LaSalle Investment Management）、嘉民集团（Goodman Group）及月桥资本有限公司（Moonbridge Capital）任职，从事房地产投资、私募房地产基金管理及相关投资管理工作。2014 年 9 月加入 DWS Group，先后担任亚太区主动股票及流动实物资产产品专家主管、亚太区产品主管等职务，现任董事总经理、全球流动实物资产产品主管。

徐柳女士，董事，伦敦政治经济学院理学硕士、中国人民大学经济学硕士。曾任职于中国国际金融股份有限公司，历任总裁研究助理，投资银行部副总经理、执行总经理、董事总经理职务，期间曾主导多项重大资本运作项目；2024 年 10 月至今，任北京金山办公软件股份有限公司副总裁。

陈重先生，独立董事，博士，中共党员，现任明石创新技术集团股份有限公司董事。曾任中国企业联合会研究部副主任、主任，常务副理事长、党委副书记；重庆市人民政府副秘书长（分管金融工作）；新华基金管理股份有限公司董事长。现兼任重庆国际信托股份有限公司独立董事、中国人寿养老保险股份有限公司独立董事、赞同科技股份有限公司独立董事、爱美客技术发展股份有限公司董事。

李一军先生，独立董事，工学博士，中共党员。曾任哈尔滨工业大学管理学院助教、讲师，副教授、室主任、副院长，教授、博士导师、院长；德国科隆大学访问教授、美国夏威夷大学访问教授；国家自然科学基金委员会管理科学部常务副主任。现任哈尔滨工业大学经济与管理学院教授、博士导师。

高峰先生，独立董事，中国香港籍，纽约州立大学石溪分校博士。曾先后就职于斯坦福

大学美国航天局艾姆斯研究中心（NASA Ames Research Center）、索罗门兄弟公司（Salomon Brothers Inc.）、美国友邦金融产品集团（AIG Financial Products Corp.）。1996 年起任职于德意志银行股份有限公司（Deutsche Bank AG），历任纽约分行银行利率交易董事，亚洲区信用产品交易主管，上海分行行长、环球市场部中国区主管、董事总经理。2008 年 1 月起任职于德意志银行（中国）有限公司（Deutsche Bank (China) Co., Ltd.），历任上海分行行长、环球市场部中国区主管、行长、董事会执行董事、董事长。高峰先生于 2020 年 4 月至 2024 年 3 月任新锐资产管理有限公司（Sprint Asset Management Limited）董事总经理；2021 年 3 月至今兼任联易融数字科技集团有限公司（Linklogis Inc.）独立董事。

张光耀先生，独立董事，管理学学士学位。曾任普华永道中天会计师事务所高级审计经理，北京天佑投资有限公司投资总监、奥特佳新能源科技有限公司上市公司监事、审计总监、董事及财务总监、采购委员会委员，冠昊生物科技股份有限公司财务总监，北京博奥晶典生物技术有限公司首席财务官。2022 年 1 月至今任恒泰柯半导体（上海）有限公司首席财务官。

经雷先生，董事，总经理，财务负责人，美国佩斯大学金融学和财会专业毕业，双学士，特许金融分析师（CFA）。1998 年 6 月至 2008 年 5 月在美国国际集团（AIG）国际投资公司美国纽约总部从事研究投资工作；2008 年 5 月至 2013 年 9 月，历任友邦保险中国区资产管理中心副总监、首席投资总监及资产管理中心负责人；2013 年 10 月入职嘉实基金管理有限公司，2013 年 10 月至 2018 年 3 月任机构投资和固定收益业务首席投资官；2018 年 3 月至今任嘉实基金管理有限公司总经理；2018 年 10 月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

沈树忠先生，监事长，正高级会计师，管理学硕士。曾任中国糖业酒类集团公司财务部科员、财务部副经理、审计部经理、财务部经理、财务总监、副总经理、常务副总经理（主持工作）、法定代表人；曾兼任北京华堂商场有限公司董事、中日合资成都伊藤洋华堂商场有限公司副董事长、酒鬼酒股份有限公司董事。现任中诚信托有限责任公司财务总监。现兼任北京三侨物业管理有限责任公司董事、法定代表人。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管，立信投资有限公司财务总监。现任立信投资有限公司监事。

高华女士，监事，法学硕士，中共党员。2006 年 9 月至 2010 年 7 月任安永华明会计师事务所高级审计师，2010 年 7 月至 2011 年 1 月任联想（北京）有限公司流程分析师，2011

年 1 月至 2013 年 11 月任银华基金管理有限公司监察稽核部内审主管。2013 年 11 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任合规管理部稽核组总监，现任人力资源总监兼董事会办公室主任。

马莲女士，监事，法学博士，中共党员。曾任北京市竞天公诚律师事务所律师，法国基德律师事务所北京代表处法律顾问，北京天驰律师事务所律师、合伙人。2013 年 9 月加入嘉实资本管理有限公司，历任法律合规总监、首席风控官。2020 年 6 月至 2025 年 7 月任嘉实财富管理有限公司副总经理、风控合规负责人。现任嘉实基金管理有限公司审计部总监。

郭松先生，督察长，硕士研究生。曾任职于国家外汇管理局、中汇储投资有限责任公司、国新国际投资有限公司。2019 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司，现任公司督察长。

姚志鹏先生，副总经理，硕士研究生。2011 年加入嘉实基金管理有限公司，曾任股票研究部研究员、基金经理、成长风格投资总监兼权益投资部总监、股票投研首席投资官，现任公司副总经理。

鲁令飞先生，副总经理，硕士研究生。2000 年 10 月加入嘉实基金管理有限公司，历任机构业务部机构销售、保险业务部总监、机构销售业务板块负责人，现任公司副总经理、首席市场官。

张敏女士，副总经理，博士研究生。2010 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司，历任风险管理部副总监、总监、首席风险官，现任公司副总经理、养老首席投资官。

刘伟先生，首席信息官，硕士研究生。2010 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司，历任信息技术部高级软件工程师、C-Lab 科技总监、数字业务部总监，现任公司首席信息官。

张丹华先生，副总经理，博士研究生。2011 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，历任研究部行业研究组研究员、研究部副总监、研究部总监、科技行业投资总监、AI Lab 负责人，现任公司副总经理、股票投资首席投资官。

2、投资总监

归凯先生，成长风格投资总监，硕士研究生。曾任国都证券研究所研究员、投资经理。2014 年 5 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任机构投资部投资经理、策略组投资总监。

张金涛先生，价值风格投资总监，硕士研究生。曾任中金公司研究部能源组组长，润晖投资高级副总裁负责能源和原材料等行业的研究和投资。2012 年 10 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任海外研究组组长、策略组投资总监。

胡永青先生，投资总监（固收+），硕士研究生。曾任天安保险固定收益组合经理，信诚基金投资经理，国泰基金固定收益部总监助理、基金经理。2013 年 11 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任策略组组长。

赵国英女士，投资总监（纯债），硕士研究生。曾任天安保险债券交易员，兴业银行资金营运中心债券交易员，美国银行上海分行环球金融市场部副总裁，中欧基金策略组负责人、基金经理。2020 年 8 月加入嘉实基金管理有限公司。

3、基金经理

朱盟邦先生，硕士研究生，7 年证券从业经历，具有基金从业资格。中国国籍。曾任中国期货市场监控中心有限责任公司研究部助理经理、中证商品指数有限责任公司指数业务一部经理、华夏基金管理有限公司研究发展部研究员。2025 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司指数投资部任分析师。2026 年 3 月 12 日至 2026 年 7 月 3 日任嘉实中证全指家用电器指数型发起式证券投资基金基金经理、2026 年 3 月 12 日至今任嘉实中证大农业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理、2026 年 3 月 12 日至今任嘉实中证大农业交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2026 年 6 月 3 日至今任嘉实国证储能电池交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2026 年 9 月 21 日至今任嘉实中证全指红利质量交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

4、指数与量化投资决策委员会

指数与量化投资决策委员会的成员包括：指数与量化投资首席投资官刘斌先生，公司总经理经雷先生，指数投资总监刘珈吟女士，股票研究部总监刘杰先生，风险管理部总监武雪冬先生，指数基金经理李直先生。

5、上述人员之间均不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，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、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照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收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回对价，编制申购赎回清单；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、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者实施其他法律行为；

12、有关法律、法规和中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守相关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反有关法律法规、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金资产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金资产；

（3）利用基金资产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）法律法规或中国证监会规定禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不得将基金资产用于以下投资或活动：

（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）向其基金管理人、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。

法律法规或监管部门调整上述禁止行为的，本基金从其规定。

4、基金经理承诺

（1）依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

（2）不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

（3）不违反现行有效的有关法律法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（4）不从事损害基金资产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

为加强内部控制，防范和化解风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障基金份额持有人利益，根据《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》并结合公司具体情况，公司已建立健全内部控制体系和内部控制制度。

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽。基本管理制度包括投资管理、信息披露、信息技术管理、公司财务管理、基金会计、人力资源管理、资料档案管理、业绩评估考核、合规管理和风险控制、紧急应变等制度。部门业务规章是对各部门的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作守则等具体说明。

2、内部控制的原则

（1）健全性原则：内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

（2）有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

（3）独立性原则：公司各机构、部门和岗位在职能上必须保持相对独立；

（4）相互制约原则：组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立；

（5）成本效益原则：运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

3、内部控制组织体系

（1）公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设合规与风险控制委员会，督促公司经理层履行职责建立有效的财务控制、内部控制的系统及制度，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

（2）投资决策委员会为公司投资管理的最高决策机构，由总经理、投资总监及资深基金经理组成，负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

（3）风险控制委员会为公司风险管理的最高决策机构，由公司总经理、督察长及相关总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

（4）督察长积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况

进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

（5）合规管理部门：公司管理层重视和支持合规风控工作，并保证合规管理部门的独立性和权威性，配备了充足合格的合规风控人员，明确合规管理部门及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。合规管理部门具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监控检查工作。

（6）业务部门：部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。

（7）岗位员工：公司努力树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。员工在其岗位职责范围内承担相应的内控责任，并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的义务。

4、内部控制措施

公司确立“制度上控制风险、技术上量化风险”，积极吸收或采用先进的风险控制技术和手段，进行内部控制和风险管理。

（1）公司逐步健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

（2）公司设置的组织结构，充分体现职责明确、相互制约的原则，各部门均有明确的授权分工，操作相互独立。公司逐步建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

（3）公司设立了顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

①各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；

②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡。

（4）公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

（5）公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

（6）授权控制应当贯穿于公司经营活动的始终，授权控制的主要内容包括：

①股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标

准和程序，确保授权制度的贯彻执行；

②公司各部门、分公司及员工在规定授权范围内行使相应的职责；

③重大业务授权采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效；

④对已获授权的部门和人员建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

（7）建立完善的基金财务核算与基金资产估值系统和资产分离制度，基金资产与公司自有资产、其他委托资产以及不同基金的资产之间实行独立运作，分别核算，及时、准确和完整地反映基金资产的状况。

（8）建立科学、严格的岗位分离制度，明确划分各岗位职责，投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员的重叠。投资、研究、交易、IT 等重要业务部门和岗位进行物理隔离。

（9）建立和维护信息管理系统，严格信息管理，保证客户资料等信息安全、真实和完整。积极维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统，各级领导、部门及员工均有明确的报告途径。

（10）建立和完善客户服务标准，加强基金销售管理，规范基金宣传推介，不得有不正当销售行为和不正当竞争行为。

（11）制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序，对发生严重影响基金份额持有人利益、可能引起系统性风险、严重影响社会稳定的突发事件，按照预案妥善处理。

（12）公司建立健全内控制度，督察长、合规管理部门对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实；定期评价内部控制的有效性并适时改进。

①对公司各项制度、业务的合法合规性进行监控核查，确保公司各项制度、业务符合有关法律、行政法规、部门规章及行业监管规则；

②对内部风险控制制度的持续监督。合规管理部门持续完善“风险责任授权体系”机制，组织相关业务部门、岗位共同识别风险点，界定风险责任人，确保所有识别出的关键风险点均有对应控制措施，及时防范和化解风险；

③督察长按照公司规定，向董事会、经营管理主要负责人报告公司经营管理的合法合规情况和合规管理工作开展情况。

5、基金管理人关于内部控制的声明

（1）基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（2）基金管理人承诺根据市场变化和基金管理人发展不断完善内部控制体系和内部控

制制度。

四、基金托管人

（一）基本情况

名称： 东方财富证券股份有限公司（简称“东方财富证券”）

住所：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市静安区永和路 118 弄东方环球企业中心 24 号楼 5 楼(基金托管部）

法定代表人： 戴彦

成立日期： 2000 年 3 月 7 日

组织形式： 股份有限公司

注册资本： 127 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：证监许可〔2022〕1134 号

联系人：黄佳一

电话：021-36531906

传真：021-36535001

东方财富证券是东方财富信息股份有限公司（证券代码：300059）旗下全资子公司，前身为西藏证券经纪有限责任公司，于 2000 年 3 月 6 日经中国证监会批准正式挂牌成立。截至 2026 年 2 月 28 日，东方财富证券注册资本为 127 亿元人民币，在全国 31 个省（自治区、直辖市）共设有 174 家营业部和 13 家分公司，拥有 4 家全资子公司。

东方财富证券基金托管部拥有一支高素质、富有经验、复合型的人才队伍，知识结构涉及金融、财会、法律、信息技术等方面，多人具有注册会计师资格、法律职业资格、高级程序员资格等。基金托管业务人力资源配置持续符合监管规定，员工均具备基金从业和证券从业资质。

（二）证券投资基金托管情况

东方财富证券于 2022 年 5 月获得中国证监会《关于核准东方财富证券股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》（证监许可〔2022〕1134 号），核准公司证券投资基金托管资格。东方财富证券始终秉持“链接人与财富，为客户创造更多价值”的企业使命，坚持“合规稳健、诚信专业、守正出奇、追求卓越”的文化理念，严格遵循法律法规、基金合同以及托管协议开展托管业务，切实维护基金份额持有人的合法权益，为广大基金份额持有人、各类资产管理产品提供高质量的托管服务。

（三）托管业务的内部控制制度

1、内部控制目标

内部控制的目标在于确保基金托管业务在合法合规的前提下安全稳健运行。具体而言，一是严格遵循国家法律法规及监管规则，全面贯彻公司内部管理制度，确保业务操作规范有序；二是通过风险识别与管理机制，有效防范和化解经营风险，切实保障托管资产完整安全，维护基金份额持有人权益；三是强化信息披露管理，确保资产运作过程及披露内容符合法律法规、监管要求、合同约定等；四是建立健全监督机制，通过查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，持续提升托管业务运行效率和质量，推动业务实现安全、有效、可持续发展。

2、内部控制组织结构

公司董事会承担公司全面风险管理的最终责任。公司董事会下设合规与风险管理委员会，负责审议风险管理的总体目标、基本政策、机构设置，评估重大决策的风险和重大风险的解决方案，审议风险评估报告等。

公司监事会承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和经营管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。

公司经营管理层根据董事会的授权，结合公司经营目标，具体负责实施风险管理工作。

公司设立风险管理部履行全面风险管理职责，风险管理部对经营管理层和公司整体风险负责。

基金托管部建立了清晰合理的组织架构，构筑了严密有效的全面风险管理“三道防线”，即通过建立重要一线岗位双人、双职、双责及岗位分离制衡机制，形成第一道防线：相关二级部对各自职责范围内的合规风险管理事项进行检查和督导，通过相关部门及相关岗位的相互制衡、监督，形成第二道防线；风险管理部对基金托管部进行全面的事前、事中、事后的风险监督与管理，形成第三道防线。

3、内部控制制度及措施

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等法律法规，基金托管人制定了一整套严密、高效的证券投资基金托管管理规章制度，包括业务管理、内部控制、操作规程、保密管理、业务档案管理、应急处理、信息披露、信息系统等方面，可以保证基金托管业务的规范、安全、高效运行，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。

基金托管人对于客户准入、资产保管、资金划付、会计核算和估值、信息系统、投资监督、信息披露等重要业务环节，通过对基金托管业务各环节风险的事前揭示、事中控制和事

后稽核的动态管理过程来实施内部风险控制。

（四）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督方法

基金托管人根据法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督，及时提示管理人违规风险，并按要求向中国证监会报告。每日对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

基金托管人发现基金管理人有违反法律法规规定及基金合同、托管协议约定的，应当及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整，并保证在规定期限内及时改正。在规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。对于管理人违反投资范围、违规事项未能在限期内纠正或存在重大违规或违约行为的，基金托管人应根据要求及时报告中国证监会。

五、相关服务机构

（一）募集期间基金份额发售机构

1、网下现金和网下股票认购发售直销机构：嘉实基金管理有限公司

嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址	北京市丰台区丽泽路16号院4号楼汇亚大厦12层		
电话	（010）65215588	传真	（010）65215577
联系人	黄娜		

2、网下现金和网下股票认购发售代理机构

详见基金份额发售公告、后续发布的调整发售机构的临时公告或基金管理人网站相关公示。

3、网上现金认购发售代理机构

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

4、基金管理人可根据有关法律法规要求，选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述发售代理机构，并及时在基金管理人网站公示。

（二）申购赎回代理券商、二级市场交易代办证券公司

1、申购赎回代理券商

本基金申购赎回代理券商信息详见基金管理人网站公示。

2、二级市场交易代办证券公司

投资者在深圳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。

（三）登记机构

名称	中国证券登记结算有限责任公司
住所、办公地址	北京市西城区太平桥大街 17 号
法定代表人	隋强
联系人	史昊
电话	（010）50938716
传真	（010）50938991

（四）出具法律意见书的律师事务所

名称	上海源泰律师事务所		
住所、办公地址	上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼		
负责人	廖海	联系人	刘佳
电话	（021）51150298	传真	（021）51150398
经办律师	刘佳、李筱筱		

（五）会计师事务所

名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)		
住所	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼		
办公地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼		
执行事务合伙人	唐恋炯	联系人	郭新华
电话	+86(21)-6141 8888	传真	+86(21)-6335 0003
经办注册会计师	郭新华、强占新		

六、基金的募集

基金管理人按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集本基金，并于 2026 年 8 月 28 日经中国证监会证监许可〔2026〕2382 号文准予募集注册。

（一）基金名称

嘉实中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金

（二）基金类型和运作方式

1、基金类型：股票型指数证券投资基金

2、基金的运作方式：交易型开放式

（三）基金存续期限

不定期

（四）发售时间与发售对象

1、发售时间

自基金份额发售之日起最长不得超过三个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

2、发售对象

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。

（五）发售方式与发售场所

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式认购本基金：

网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构使用深圳证券交易所网上系统以现金进行的认购；

网下现金认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构使用证券交易所网上系统以外的系统以现金进行的认购；

网下股票认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以组合证券或基金合同约定的其他对价进行的认购。

基金管理人可以根据具体情况调整本基金的发售方式，并在基金份额发售公告或相关公告中列明。

基金管理人可依据实际情况增减、变更发售代理机构，在基金管理人网站公示。发售代理机构的具体名单见基金份额发售公告。

若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司对发售方式、发售场所有所调整的，本基金将进行相应调整。

（六）基金份额发售面值、认购价格

本基金每份基金份额的发售面值为人民币 1.00 元，认购价格为人民币 1.00 元。

（七）投资人对基金份额的认购

1、认购时间安排

本基金的募集期限不超过 3 个月，具体发售时间见基金份额发售公告。

2、认购开户

投资人认购本基金时需具有深圳证券交易所 A 股账户或证券投资基金账户（以下统称“深圳证券账户”）。

已有深圳证券交易所 A 股账户或证券投资基金账户的投资人不必再办理开户手续。尚无深圳证券交易所 A 股账户或证券投资基金账户的投资人，需在认购前持本人身份证到中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构办理深圳证券交易所 A 股账户或证券投资基金账户的开户手续。有关开设深圳证券交易所 A 股账户和证券投资基金账户的具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询有关规定。

如投资人需新开立证券账户，则应注意：

①深圳证券交易所证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易，如投资人需要使用中证人工智能主题指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金份额的申购、赎回，则应开立深圳证券交易所 A 股账户；如投资者需要使用中证人工智能主题指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立上海证券交易所 A 股账户。

②如投资人需要通过申购赎回代理券商参与本基金的申购、赎回，应同时持有并使用深圳证券交易所 A 股账户与上海证券交易所 A 股账户。

③如投资人同时使用深圳证券交易所 A 股账户与上海证券交易所 A 股账户，该两个账户的证件号码及名称应属于同一投资人所有，并注意投资人用以认购、申购、赎回的深圳证券交易所股票的托管证券公司和上海证券交易所 A 股账户的指定交易证券公司应为同一申购赎回代理券商机构，否则无法办理本基金的申购和赎回。

（八）认购费用

本基金的认购采用份额认购的原则。认购费用由通过发售代理机构认购基金份额的投资人承担，认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售等发售期间发生的各项

费用。认购费率如下表所示：

认购份额 S	认购费率
S＜100 万份	0.30%
S≥100 万份	每笔收款，1000 元/笔

基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购时不收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金，投资者多次提交现金认购申请的，须按每笔认购申请所对应的费率档次分别计费。

（九）认购申请的确认

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。投资者按照基金合同的约定提交认购申请并交纳认购基金份额的款项或股票时，基金合同成立；基金管理人按照规定办理完毕基金募集的备案手续，基金合同生效。认购的确认以登记机构的确认结果以及基金合同生效为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。

（十）网上现金认购

1、认购时间：详见基金份额发售公告。

2、认购限额：网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额须为 1,000 份或其整数倍。投资人可多次认购，累计认购份额不设上限，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

3、认购金额、认购佣金的计算：

通过发售代理机构进行网上现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购佣金、认购金额的计算公式为：

认购佣金＝认购价格×认购份额×认购费率

（或若适用固定费用的，认购佣金=固定费用）

认购金额＝认购价格×认购份额×(1＋认购费率)

（或若适用固定费用的，认购金额＝认购价格×认购份额+固定费用）

利息折算的份额=利息/认购价格

总认购份额=认购份额+利息折算的份额

认购佣金由发售代理机构向投资人收取，投资人需以现金方式交纳认购佣金。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

网上现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资人所有。网上现金认购的利息和具体份额以基金管理人或登记机构的记录为准。

例：某投资人通过某发售代理机构以网上现金认购方式认购 10,000 份本基金份额，假设该发售代理机构确认的认购费率为 0.30%，该笔认购金额产生利息 10 元，则投资人需支付的认购佣金和需准备的认购金额计算如下：

认购佣金＝1.00×10,000×0.30%＝30.00 元

认购金额＝1.00×10,000×(1+0.30%)＝10,030.00 元

利息折算的份额=10/1.00=10.00 份

总认购份额=10,000+10.00=10,010.00 份

即投资人通过某发售代理机构以网上现金认购方式认购本基金，需准备 10,030.00 元资金，方可认购到 10,000 份本基金基金份额。假设该笔认购金额产生利息 10 元，则投资者实际可得到 10,010.00 份基金份额。

4、认购手续：投资人在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。投资者可多次申报，不可撤单，申报一经确认，认购资金即被冻结。

5、清算交收：投资者提交的认购委托，由登记机构进行有效认购款项的清算交收。

6、认购确认：在基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点或以其提供的其他方式查询认购确认情况。

（十一）网下现金认购

1、认购时间：详见基金份额发售公告。

2、认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为 1,000 份或其整数倍，投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在 5 万份以上（含 5 万份），投资人可多次认购，累计认购份额不设上限，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

3、认购金额、认购费用的计算：

（1）通过基金管理人进行网下现金认购的投资人，不收取认购费，认购以基金份额申请，认购金额的计算公式为：

认购金额＝认购份额×基金份额发售面值

利息折算的份额＝利息/认购价格

总认购份额=认购份额+利息折算的份额

利息折算的份额保留至整数位，小数部分舍去，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

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，将折算为基金份额归投资人所有。网下现金认购的利息和具体份额以基金管理人或登记机构的记录为准。

例：某投资人通过基金管理人以网下现金认购方式认购 100,000 份本基金，不收取认购费，利息为 10 元，则投资人需准备的认购金额计算如下：

认购金额＝1.00×100,000＝100,000.00 元

利息折算的份额=10/1.00=10.00 份

投资人实际可得份额=100,000+10=100,010.00 份

即，投资人通过基金管理人办理网下现金认购需准备 100,000.00 元资金方可认购到 100,000.00 份本基金基金份额，假设该笔认购金额产生利息 10 元，其最终实际所得的基金份额为 100,010.00 份。

（2）通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算：同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

4、认购手续：投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后不得撤销。

5、清算交收：通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人进行有效认购款项的清算交收。通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，根据登记机构相关规定进行有效认购款项的清算交收。

6、认购确认：在基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点或以其提供的其他方式查询认购确认情况。

（十二）网下股票认购

1、认购时间：详见基金份额发售公告。

2、认购限额：网下股票认购以单只股票股数申报，用于认购的股票必须是中证人工智能主题指数的成份股和已经公告的备选成份股。单只股票最低认购申报股数为 1,000 股，超过 1,000 股的部分须为 100 股的整数倍。投资人可多次提交认购申请，累计申报数不设上限，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

3、认购手续：投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购股票。认购一经确认不得撤销。

4、特殊情形

特殊情形包括但不限于以下几种情况：

（1）已经公告的即将被调出中证人工智能主题指数的成份股不得用于认购本基金。

（2）限制个股认购规模：基金管理人可根据网下股票认购日前 3 个月的个股的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购日前至少 3 个工作日公告限制认购规模的个股名单。

（3）临时拒绝个股认购：对于在网下股票认购期间价格波动异常、认购申报数量异常、流通受限或存在其他异常情况的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。

（4）根据法律法规本基金不得持有的标的指数成份股，将不能用于认购本基金。

5、清算交收

网下股票认购期 T 日日终（T 日为本基金发售期最后一日），发售代理机构将当日的股票认购数据按投资人证券账户汇总发送给基金管理人，基金管理人初步确认各成份股的有效认购数量。T+1 日起，登记机构根据基金管理人提供的确认数据，冻结上海市场网下认购股票，并将深圳市场网下认购股票过户至本基金组合证券认购专户。通过发售代理机构进行网下股票认购，以基金份额方式支付佣金的，基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资人应以基金份额方式支付的认购费用，并从投资人的认购份额中扣除，然后将扣除的认购费用以基金份额的形式返还给发售代理机构。登记结算机构根据基金管理人提供的有效认购申请股票数据，将上海和深圳的股票分别过户至本基金在上海、深圳开立的证券账户。基金合同生效后，登记结算机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记。

若深圳证券交易所、登记机构对网下股票认购业务的清算交收流程有所修订或调整的，本基金将进行相应调整。

6、网下股票认购份额的计算公式

认购份额＝$\sum_{i=1}^{n}$（第 i 只股票在网下股票认购期最后一日的均价×有效认购数量）／基金份额发售面值

其中：

（1）i 代表投资人提交认购申请的第 i 只股票，n 代表投资人提交的股票总只数，如投资人仅提交了 1 只股票的申请，则 n＝1；

（2）“第 i 只股票在网下股票认购期最后一日的均价”由本基金管理人根据证券交易所的当日行情数据，以该股票的总成交金额除以总成交股数计算，以四舍五入的方法保留至小

数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交，则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某只股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生了除息、送股（转增）、配股等权益变动，由于投资人获得了相应的权益，基金管理人将按如下方式对该股票在网下股票认购期最后一日的均价进行调整：

1）除息：调整后价格＝网下股票认购期最后一日均价－每股现金股利或股息

2）送股：调整后价格＝网下股票认购期最后一日均价／（1＋每股送股比例）

3）配股：调整后价格＝（网下股票认购期最后一日均价＋配股价×配股比例）／（1＋每股配股比例）

4）送股且配股：调整后价格＝（网下股票认购期最后一日均价＋配股价×配股比例）／（1＋每股送股比例＋每股配股比例）

5）除息且送股：调整后价格＝（网下股票认购期最后一日均价－每股现金股利或股息）／（1＋每股送股比例）

6）除息且配股：调整后价格＝（网下股票认购期最后一日均价＋配股价×配股比例－每股现金股利或股息）／（1＋每股配股比例）

7）除息、送股且配股：调整后价格＝（网下股票认购期最后一日均价＋配股价×配股比例－每股现金股利或股息）／（1＋每股送股比例＋每股配股比例）

（3）“有效认购数量”是指由基金管理人确认的并由登记机构完成清算交收的股票股数。其中：

1）对于经公告限制认购规模的个股，基金管理人可确认的认购数量上限为：

$$q^{max}=(Cash+\sum_{j=1}^{n}p_jq_j)\times 105\%\times w/p$$

- q^{max} 为限制认购规模的单只个股最高可确认的认购数量；
- $Cash$ 为网上现金认购和网下现金认购的合计申请数额；
- p_jq_j 为除限制认购规模的个股和基金管理人全部或部分临时拒绝的个股以外的其他个股在网下股票认购期最后一日均价和认购申报数量乘积；
- w 为该股按均价计算的其在网下股票认购期最后一日中证人工智能主题指数中的权重。认购期间，如中证人工智能主题指数发布指数调整公告，则基金管理人根据公告调整后的成份股名单及中证人工智能主题指数编制规则计算调整后的中证人工智能主题指数构成权重，作为计算依据；

- p 为该股在网下股票认购期最后一日的均价。

如果投资人申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限，基金管理人则按照各投资人的认购申报数量同比例收取确认投资人提交认购的股票。

2）某一股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生司法执行，基金管理人将根据登记机构确认的实际过户数据对投资人的有效认购数量进行相应调整。

7、网下股票认购计算举例

通过发售代理机构进行网下股票认购的投资人，认购以单只股票股数申请，在发售代理机构允许的条件下，投资人可选择以现金或基金份额的方式支付认购费用/佣金。认购费用/佣金的计算公式为：

（1）如投资人选择以现金支付认购费用/佣金，则需支付的认购费用/佣金如下：

认购费用/佣金=认购份额×基金份额发售面值×认购费率或佣金比率

（2）如投资人选择以基金份额的方式交纳认购费用/佣金，则需支付的认购费用/佣金如下：

认购费用/佣金=基金份额发售面值×认购份额/（1＋认购费率或佣金比率）×认购费率或佣金比率

净认购份额=认购份额－认购费用或佣金/基金份额发售面值

认购费用/佣金保留到整数位，小数部分舍去。

例：某投资人持有中证人工智能主题指数成份股中股票 A 10,000 股，至某发售代理机构网点认购本基金，选择以现金支付认购费用。假设 202×年×月×日股票 A 的均价为 25.50 元，基金管理人确认的有效认购数量为 10,000 股股票 A，发售代理机构确认的认购费率为 0.30%，则其可得到的基金份额和需支付的认购佣金如下：

认购份额=（10,000×25.50）÷1.00＝255,000 份

认购费用=1.00×255,000×0.30%＝765 元

即投资人可认购到 255,000 份本基金基金份额，并需另行支付 765 元的认购佣金。

续上例：假设该投资人选择以基金份额的方式交纳认购佣金，则投资人最终可得的净认购份额为：

认购份额=（10,000×25.50）÷1.00=255,000 份

认购佣金=1.00×255,000÷（1+0.30%）×0.30%=762 元

净认购份额＝255,000－762÷1.00＝254,238 份

即该投资人可确认得到 254,238 份基金份额，并已通过基金份额方式支付了 762 元的认购佣金。

8、认购确认：在基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点或以其提供的其他方式查询认购确认情况。

9、特别提示：投资人应根据法律法规及证券交易所相关规定进行股票认购，并及时履行因股票认购导致的股份减持所涉及的信息披露等义务。

（十三）募集期间认购资金与股票的处理方式

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。募集的股票由登记机构予以冻结。

（十四）ETF 联接基金

本基金基金合同生效后，基金管理人可发行并管理本基金的联接基金，该 ETF 联接基金将投资于本基金，与本基金跟踪同一标的指数。

（十五）在不违反法律法规强制性规定的前提下，基金管理人可根据基金发展需要，经与基金托管人协商一致并履行相关程序后，为本基金增设基金份额类别，或开通场外申购、赎回相关业务并制定、公布相应的交易规则等，无须召开基金份额持有人大会审议。

七、基金合同的生效

（一）基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不少于 2 亿元人民币且基金份额有效认购人数不少于 200 人的条件下，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，并在募集结束之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，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。

基金募集达到基金备案条件的，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，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。网下股票认购所募集的股票由登记机构予以冻结，冻结期间的股票权益及孳息归属按照相关业务规则处理。

（二）基金合同不能生效时募集资金和股票的处理方式

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：

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2、针对投资者以现金交纳的认购资金，在基金募集期限届满后 30 日内返还投资者已交纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；已冻结的股票应根据交易所及登记机构相关规则予以解冻并退还投资人。

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。

（三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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，并于 6 个月内召集基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

八、基金份额的上市交易

（一）基金份额的上市

基金合同生效后，在符合深圳证券交易所相关规定的条件下，基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》，向深圳证券交易所申请基金份额上市：

1、本基金场内资产净值不少于 2 亿元；

2、本基金场内份额持有人不少于 1000 人；

3、符合法律法规及深圳证券交易所规定的其他条件。

基金上市前，基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金获准在深圳证券交易所上市的，基金管理人应按照相关规定发布基金份额上市交易公告书及其提示性公告。

（二）基金份额的上市交易

基金份额在深圳证券交易所的上市交易应遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》等有关规定。

（三）停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市的情形和处理方式

本基金份额在深圳证券交易所上市后，如遇停复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市的情形，按照《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的相关规定执行。

若本基金发生深圳证券交易所相关规则所规定的因不再具备上市条件而应当终止上市的情形时，本基金可由交易型开放式基金变更为跟踪标的指数的非上市开放式指数基金，而无需召开基金份额持有人大会审议。届时，基金管理人可变更本基金的登记机构、相应调整申购赎回业务规则、提前制定基金终止上市后场内份额的处理规则并公告，同时，基金管理人可按照《信息披露办法》的规定，公告变更后的基金合同及招募说明书。

若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则基金管理人将本着维护基金份额持有人合法权益的原则，将本基金与该指数基金合并而无需召开基金份额持有人大会。

上述基金变更或合并的具体安排见基金管理人届时发布的相关公告。

（四）基金份额参考净值的计算与公告

基金管理人在每一个交易日开市前公告当日的申购赎回清单。本基金基金份额参考净值（IOPV）由基金管理人或基金管理人委托的机构计算，并按照相关规定发布，供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

（1）基金份额参考净值的计算公式：

基金份额参考净值＝（申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额总额＋申购赎回清单中可以现金替代的所有成份证券的数量与其最新成交价乘积之和＋申购赎回清单中禁止

现金替代的所有成份证券的数量与其最新成交价乘积之和＋申购赎回清单中的预估现金差额）／最小申购赎回单位所对应的基金份额

（2）基金份额参考净值的计算以四舍五入的方法保留至小数点后 4 位。

（3）基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。如深圳证券交易所对基金份额参考净值的计算方法另有规定的，从其规定。

（五）其他

若深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，本基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能，而无需召开基金份额持有人大会。

相关法律法规、中国证监会、登记机构或深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金按照新规定执行，若由此需要对基金合同进行修改的，此项修改无须召开基金份额持有人大会。

在不违反法律法规强制性规定的前提下，本基金可以在履行适当程序后，申请在包括境外交易所在内的其他证券交易所上市交易，而无需召开基金份额持有人大会。

九、基金份额的申购、赎回

（一）申购和赎回场所

投资者应当在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。

基金管理人在开始办理申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商，并在基金管理人网站公示。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日的开放时间办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金合同生效后，基金管理人在满足监管要求的情况下，根据本基金运作的需要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。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

本基金可在基金上市交易之前开始办理申购、赎回，但在基金申请上市期间，可暂停办理申购、赎回。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请，登记机构有权拒绝，如登记机构接收的，视为投资人在下一开放日提出的申购、赎回申请，并按照下一开放日的申请处理。

（三）申购与赎回的原则

1、“份额申购、份额赎回”原则，即申购、赎回均以份额申请；

2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价；

3、申购、赎回申请提交后不得撤销；

4、申购、赎回应遵守深圳证券交易所、登记机构的相关业务规则、通知或指南等规定；

5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

基金管理人可在不违反法律法规强制性规定的前提下，或依据深圳证券交易所或登记机构相关规则及其变更调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

（四）申购与赎回的程序

本基金按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定进行申购、赎回，具体业务的办理时间请参见相关公告。

本基金采用场内申赎模式，场内申赎模式通过深圳证券交易所办理。

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据申购赎回代理券商或基金管理人规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按申购赎回清单的规定备足申购对价，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的申购、赎回申请无效。

2、申购和赎回申请的确认

投资人申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资人未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。

申购、赎回代理券商对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表申购、赎回代理券商确实接收到该申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

基金投资人申购的基金份额当日可竞价卖出，次一交易日可赎回或大宗卖出；投资人赎回获得的股票当日可竞价卖出，次一交易日可以用于申购 ETF 份额或者大宗卖出。即在目前结算规则下，T 日申购的基金份额当日可卖出，T+1 日可赎回；投资人赎回获得的股票当日可卖出，T+1 日可用于申购 ETF 份额。

3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额、现金替代退补款及其他对价的清算交收适用相关业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定。

对于本基金的申购业务采用净额结算的方式，即深圳证券交易所上市的成份股及其现金替代及对应的上海证券交易所上市的成份股的现金替代、北京证券交易所上市的成份股的现

金替代（如有）采用净额结算；对于本基金的赎回业务采用净额结算的方式，即深圳证券交易所上市的成份股及其现金替代及上海证券交易所上市的成份股的现金替代、北京证券交易所上市的成份股的现金替代（如有）采用净额结算；本基金上述申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。

投资者 T 日申购成功后，登记机构在 T 日收市后为投资者办理深圳证券交易所上市的成份股交收与基金份额的交收登记以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。

投资者 T 日赎回成功后，登记机构在 T 日收市后办理深圳证券交易所上市的成份股交收与基金份额的注销以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。

如果登记机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据相关业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定进行处理。

投资人应按照基金合同的约定和申购赎回代理券商的规定按时足额支付应付的现金差额和现金替代退补款。因投资人原因导致现金差额或现金替代退补款未能按时足额交收的，基金管理人有权为基金的利益向该投资人追偿，并要求其承担由此导致的其他基金份额持有人或基金资产的损失。

4、基金管理人、深圳证券交易所、登记机构可在法律法规允许的范围内，对上述基金份额申购赎回的程序以及清算交收和登记的办理时间、方式、处理规则等进行调整，基金管理人应最迟于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

（五）申购与赎回的数额限制

1、投资人申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。本基金最小申购赎回单位请参考届时发布的申购、赎回相关公告以及申购赎回清单。

基金管理人可根据基金运作情况、市场变化以及投资者需求等因素对基金的最小申购赎回单位进行调整，并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

2、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购份额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述一项或多项措施对基金规模予以控制，具体以基金管理人相关公告为准。

3、基金管理人可以根据市场情况、市场变化以及投资者需求等因素，在不违反法律法规强制性规定的情况下，调整上述申购和赎回的数量或比例等限制，或者新增基金申购或赎回的控制措施。基金管理人应在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

（六）申购与赎回的对价和费用

1、本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失归入基金财产。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

2、申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价。赎回对价是指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回申请人的组合证券、现金替代、现金差额和/或其他对价。

3、申购赎回清单由基金管理人编制。T日的申购赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。

4、投资者在申购本基金时，申购赎回代理券商可按照不超过0.30%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。投资者在赎回本基金时，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。

5、未来，若市场情况发生变化，或相关业务规则发生变化，基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间进行调整并提前公告。

（七）申购赎回清单的内容与格式

1、申购赎回清单的内容

T 日申购赎回清单公告内容包括最小申购赎回单位所对应的申赎现金、组合证券内各成份证券数据、现金替代、T 日预估现金差额、T-1 日的现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

2、申赎现金

“申赎现金”不属于组合成份证券，是为了便于登记机构的清算交收安排，在申购赎回清单中增加的虚拟证券。“申赎现金”的现金替代标志为“必须”，但含义与组合成份证券的必须现金替代不同，“申赎现金”的申购替代金额为最小申购单位所对应的现金替代标志为“必须”的非深市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的非深市成份证券的申购替代金额之和，赎回替代金额为最小赎回单位所对应的现金替代标志为“必须”的非深市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的非深市成份证券的赎回替代金额之和。

3、组合证券相关内容

组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

4、现金替代相关内容

现金替代指申购或赎回过程中，投资人按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合

证券中部分证券的一定数量的现金。

（1）现金替代分为 3 种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

对于深圳证券交易所上市的成份证券，现金替代的类型可以设为：“禁止”、“允许”和“必须”。

对于上海证券交易所、北京证券交易所（如有）上市的成份证券，可以设为：“允许”和“必须”。

禁止现金替代适用于深圳证券交易所上市的成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代适用于所有成份股。

对于标志为可以现金替代的深圳证券交易所上市的成份股，申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

对于标志为可以现金替代的上海证券交易所、北京证券交易所（如有）上市的成份股，申购赎回基金份额时，均使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。

必须现金替代适用于所有成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

（2）可以现金替代

可以现金替代的组合证券分为：深圳证券交易所成份证券、上海证券交易所成份证券和北京证券交易所成份证券（如有）。

1）关于深圳证券交易所成份证券可以现金替代的情形

①适用情形：投资者申购时持仓不足的深圳证券交易所成份证券。登记机构先用深圳证券交易所成份证券，不足时差额部分用现金替代。

②替代金额：

替代金额＝替代证券数量×该证券参考价格×（1＋现金替代溢价比例）

其中，“该证券参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。

如果深圳证券交易所参考价格确定原则发生变化，以深圳证券交易所通知规定的参考价格为准。

收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在该证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金买入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金买入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资人收

取欠缺的差额。

③替代金额的处理程序如下：

T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。

在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（即 T＋2 日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的成份证券。

T＋2 日日终，若基金管理人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买入成本（包括买入价格和交易费用）的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项；若基金管理人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的实际买入成本加上按照 T＋2 日收盘价计算的未购入部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。

特例情况：若自 T 日起，深圳证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券的正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券的实际购入成本加上按照最近一次收盘价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人或投资人应补交的款项。若现金替代日（T 日）后至 T+2 日（若在特例情况下，则为 T 日起第 20 个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

T+2 日后第 1 个工作日（若在特例情况下，则为 T 日起第 21 个交易日），基金管理人将应退款和应补款的明细及汇总数据发送至登记机构，登记机构办理现金替代多退少补款的清算，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。如遇特殊情况，基金管理人有权延后发送数据并延迟交收相关款项。

④替代限制：为有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，基金管理人可规定投资人使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为：

$$\text{现金替代比例}(\%) = \frac{\sum(\text{第 i 只替代证券的数量} \times \text{该证券参考价格})}{\text{申购基金份额} \times \text{T} - 1 \text{ 日基金份额净值}} \times 100\%$$

其中，“该证券参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。

如果深圳证券交易所现金替代比例计算公式发生变化，以深圳证券交易所通知规定的为准。

2）关于上海证券交易所成份证券可以现金替代的情形

①适用情形：投资者申购和赎回时的上海证券交易所成份证券。登记机构对设置可以现金替代的上海证券交易所成份证券全部用现金替代。

②替代金额：

申购的替代金额＝替代证券数量×该证券参考价格×（1+申购现金替代溢价比例）。

赎回的替代金额＝替代证券数量×该证券参考价格×（1-赎回现金替代折价比例）。

其中，“该证券参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。

如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。

申购时收取申购现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将买入该证券，实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定申购现金替代溢价比例，并据此收取申购替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本（包括买入价格与交易费用），则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本（包括买入价格与交易费用），则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

赎回时扣除赎回现金替代折价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将卖出该证券，实际卖出价格扣除相关交易费用后与赎回时的参考价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定赎回现金替代折价比例，并据此支付赎回替代金额。如果预先支付的金额低于基金卖出该部分证券的实际收入（包括买入价格与交易费用），则基金管理人将退还少支付的差额；如果预先支付的金额高于基金卖出该部分证券的实际收入（包括买入价格与交易费用），则基金管理人将向投资者收取多支付的差额。

③替代金额的处理程序如下：

T 日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比例和现金替代折价比例，并据此收取申购替代金额和支付赎回替代金额。

基金管理人将自 T 日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的成份证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次卖出赎回被替代的成份证券。T 日未完成的交易，基金管理人在 T 日后被替代的成份证券有正常交易的 2 个交易日（简称为 T+2 日）内完成上述交易。

时间优先的原则为：申购赎回方向相同的，先确认成交者优先于后确认成交者。先后顺序按照深圳证券交易所确认申购赎回的时间确定。

实时申报的原则为：基金管理人在上海证券交易所连续竞价期间，根据收到的深圳证券交易所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向上海证券交易所申报被替代证券的交易指令。

基金管理人按照“时间优先”的原则依次与申购投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照申购时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；按照“时间优先”的原则依次与赎回投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照赎回时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

对于 T 日因停牌或流动性不足等原因未购入和未卖出的被替代的部分证券，T 日后基金管理人可以继续进行被替代证券的买入和卖出，按照前述原则确定基金应退还投资者或投

资者应补交的款项。

T+2 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，确定基金应退还申购投资者或申购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（包括买入价格与交易费用）加上按照 T+2 日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项。

T+2 日日终，若已卖出全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项；若未能卖出全部被替代的证券，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照 T+2 日收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

特例情况：若自 T 日起，上海证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

若现金替代日（T 日）后至 T+2 日（若在特例情况下，则为 T 日起第 20 个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

T+2 日后第 1 个工作日（若在特例情况下，则为 T 日起第 21 个交易日），基金管理人将应退款和应补款的明细及汇总数据发送至登记机构，登记机构办理现金替代多退少补款的清算，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。如遇特殊情况，基金管理人有权延后发送数据并延迟交收相关款项。

3）指数成份股如包含北京证券交易所上市成份股的，可参照上海证券交易所上市成份股的相关规则进行处理，具体参照交易所及中国证券登记结算有限责任公司发布的最新规则。

（3）必须现金替代

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；或因法律法规限制投资的成份证券；或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要设置必须现金替代的成份证券。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其 T 日预估开盘价。

5、预估现金差额

预估现金差额指由基金管理人计算并在 T 日申购赎回清单中公布的当日现金差额的预估值，预估现金差额由申购赎回代理券商（代办证券公司）预先冻结。

T 日预估现金差额在 T 日申购赎回清单中公告，其计算公式为：

T 日预估现金差额＝T-1 日最小申购赎回单位的基金资产净值－（申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额总额+申购赎回清单中可以现金替代的所有成份证券的数量与该证券参考价格乘积之和＋申购赎回清单中禁止现金替代的所有成份证券的数量与该证券参考价格乘积之和）

其中，“该证券参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。另外，若 T 日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1 日最小申购赎回单位的基金资产净值”需要扣减相应的收益分配数额，若 T 日为基金篮子份额调整生效日，则计算公式中的“T-1 日最小申购、赎回单位的资产净值”需根据调整前后篮子份额按比例计算。

预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。

6、现金差额

现金差额指最小申购赎回单位的资产净值与按当日收盘价计算的最小申购赎回单位中的组合证券市值和现金替代之差。投资人申购、赎回时应支付或应获得的现金差额根据最小申购赎回单位对应的现金差额、申购或赎回的基金份额数计算。

T 日现金差额在 T＋1 日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：

T 日现金差额＝T 日最小申购赎回单位的基金资产净值－（申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额总额＋申购赎回清单中可以现金替代的所有成份证券的数量与该证券 T 日收盘价乘积之和＋申购赎回清单中禁止现金替代的所有成份证券的数量与该证券 T 日收盘价乘积之和）

T 日投资人申购、赎回的基金份额，需按 T＋1 日公告的 T 日现金差额进行资金的清算交收。现金差额的数值可能为正、为负或为零。

在投资人申购时，如现金差额为正数，则投资人应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资人将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资人赎回时，如现金差额为正数，则投资人将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资人应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

7、申购赎回清单的格式

基本信息

基金名称：	嘉实中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称：	嘉实基金管理有限公司
基金代码：	158075
目标指数代码：	930713
基金类型：	跨市场 ETF

202X-XX-XX-1 信息内容

现金差额（元）：	XXXX.XX
最小申购、赎回单位资产净值（元）：	XXXX.XX
基金份额净值（元）：	X.XXXX

202X-XX-XX 信息内容

预估现金差额（元）：	XXXX.XX
可以现金替代比例上限：	XX.XX%
是否需要公布 IOPV：	是
最小申购、赎回单位（份）：	XXXXXX
最小申购赎回单位现金红利(元)：	0
申购赎回组合证券只数：	XX
全部申购赎回组合证券只数：	
是否开放申购：	是
是否开放赎回：	是
当天净申购的基金份额上限(份)：	不限
当天净赎回的基金份额上限(份)：	不限
单个证券账户当天净申购的基金份额上限(份)：	不限
单个证券账户当天净赎回的基金份额上限(份)：	不限
当天累计可申购的基金份额上限(份)：	不限
当天累计可赎回的基金份额上限(份)：	不限
单个证券账户当天累计可申购的基金份额上限(份)：	不限
单个证券账户当天累计可赎回的基金份额上限(份)：	不限

组合信息内容

证券代码	证券简称	股份数量	现金替代标志	申购现金替代保证金率	赎回现金替代保证金率	申购替代金额	赎回替代金额	挂牌市场	映射代码	是否实物对价申赎

说明：此表仅为示意，具体以深圳证券交易所公布的实际清单为准。

若深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购赎回清单的格式进行调整，基金管理人将视情况对相关格式进行相应的调整。

（八）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作或无法受理投资人的申购申请。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

3、证券交易所或期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法进行证券交易。

4、基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单、基金份额净值或者 IOPV 计算

错误、申购赎回清单编制错误。

5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、相关证券/期货交易所、申购赎回代理券商、登记机构等因异常情况无法办理申购；或者指数编制单位、相关证券/期货交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。

7、占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接受基金申购申请。

8、基金管理人可根据市场情况在申购赎回清单中设置申购上限，当一笔新的申购申请被确认成功，会使本基金当日申购超过申购赎回清单中规定的申购上限时，该笔申购申请将被拒绝。

9、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益。

10、法律法规、交易规则规定或深圳证券交易所、中国证监会认定的其他情形。

上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等。

发生上述第 1 项至第 7 项及第 10 项拒绝或暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据《信息披露办法》的规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。在暂停申购的情况消除时（第 8 项、第 9 项除外），基金管理人应及时恢复申购业务的办理并公告。

（九）暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形

发生下列情形之一时，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对价：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作或无法受理基金份额持有人的赎回申请。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

3、证券交易所或期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或无法进行证券交易。

4、接受某笔或某些赎回申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人可根据市场情况在申购赎回清单中设置赎回份额上限，当一笔新的赎回申请被确认成功，会使本基金当日赎回份额超过申购赎回清单中规定的赎回份额上限时，该

笔赎回申请将被拒绝。

7、占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，基金管理人应当延缓支付赎回对价或暂停接受基金赎回申请。

8、法律法规、交易规则规定或深圳证券交易所、中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形（第 4 项、第 6 项除外）之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回对价时，基金管理人应当根据《信息披露办法》的规定在规定媒介上刊登公告并按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付。在暂停赎回的情况消除时（第 4 项、第 6 项除外），基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

（十）其他申购、赎回相关规定

1、在不违反法律法规强制性规定的情况下，基金管理人可以根据具体情况履行适当程序后开通本基金的场外申购赎回等业务，无需召开基金份额持有人大会。场外申购赎回的具体办理方式等相关事项届时将另行公告。

2、在条件允许时，基金管理人可开放集合申购。集合申购业务的相关规则由基金管理人制定，并依照《信息披露办法》的有关规定公告。

3、在条件允许时，基金管理人可以在不违反法律法规强制性规定的情况下，采取其他合理的申购、赎回方式，并于新的申购、赎回方式开始执行前予以公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规强制性规定的情况下，调整基金申购赎回方式或申购赎回对价组成，并提前公告。

5、若基金管理人推出本基金的 ETF 联接基金，ETF 联接基金可以特殊申购本基金基金份额，不收取申购费用。

6、基金管理人指定的代理机构可依据法律法规和基金合同的规定开展其他服务，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

7、对于符合要求的特定机构投资者，基金管理人可在不违反法律法规强制性规定的情况下，安排专门的申购赎回方式，并于新的申购赎回方式开始执行前另行公告。

（十一）基金份额折算

基金管理人可向登记机构申请办理基金份额折算与变更登记。基金份额折算后，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变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响，无需召开基金份额持有人大会。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。基金管理人应就其具体事宜进行必要公告，并提前通知基金托管人。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力或登记机构遇特殊情况无法办理的，基金管理人可延迟办理基金份额折算。

基金份额折算的具体方法在基金份额折算公告中列示。

（十二）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给公益性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书和协助执行通知书要求登记机构将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

（十三）基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

（十四）基金的质押

在条件允许的情况下，登记结算机构可依据相关法律法规及其业务规则，办理基金份额质押业务，并收取一定的手续费。

（十五）基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管机构另有规定的除外。

（十六）基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

（十七）若深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司针对交易型开放式指数证券投资基金修改现有的清算交收与登记模式或引入新的申购、赎回方式，基金管理人有权根据新的业务规则进行调整，并在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，无须召开基金份额持有人大会审议。

十、基金的投资

（一）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%。

（二）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（包含主板、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。

（三）投资策略

1、股票投资策略

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。

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投资目标所述范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

2、存托凭证投资策略

本基金可投资存托凭证，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、

公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。

3、债券投资策略

（1）类属配置策略

类属配置是指对各市场及各种类的固定收益类金融工具之间的比例进行适时、动态的分配和调整，确定最能符合本基金风险收益特征的资产组合。投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行债券资产的投资，通过主要采取组合久期配置策略构建投资组合。

（2）可转换债券与可交换公司债券投资策略

可转换债券与可交换公司债券投资方面，兼具权益类证券与固定收益类证券的特性。本基金一方面将对发债主体的信用基本面进行深入挖掘以明确该可转换债券/可交换公司债券的债底保护，防范信用风险，另一方面，还会进一步分析标的公司的盈利和成长能力以确定可转换债券/可交换公司债券中长期的上涨空间。本基金将借鉴信用债的基本面研究，从行业基本面、公司的行业地位、竞争优势、财务稳健性、盈利能力、治理结构等方面进行考察，精选财务稳健、信用违约风险小的可转换债券/可交换公司债券进行投资。本基金将在定量分析与主动研究相结合的基础上，结合可转换债券/可交换公司债券定价模型、交易价格以及其转股价值，对可转换债券/可交换公司债券是否转股制定投资策略以及选择合适的转换时机。

4、资产支持证券投资策略

资产支持证券为本基金的辅助性投资工具，本基金将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。

5、衍生品投资策略

为更好地实现投资目标，基金还可以投资于股指期货、股票期权、国债期货。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与股指期货的投资，以提高投资效率，控制基金投资组合风险水平，更好地实现本基金的投资目标。本基金管理人运用股指期货等金融衍生工具必须是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，不得应用于投机交易目的，或用作杠杆工具放大基金的投资。

本基金投资股票期权，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，充分考虑股票期权的流动性和风险收益特征。

本基金参与国债期货交易，应当根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。基金

管理人将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

6、参与融资及转融通证券出借业务策略

为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与融资及转融通证券出借业务。本基金将在分析市场情况、投资者类型与结构、本基金历史申赎数据、出借证券流动性情况等因素，合理确定出借证券的范围、期限和比例。若相关融资及转融通业务的法律法规发生变化，本基金将从其最新规定。

7、随着证券市场投资工具的发展和丰富，基金管理人可在不改变投资目标的前提下，根据法律法规的有关规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并公告。

（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）本基金投资于标的指数成份股、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%；

（2）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%；

（3）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%；

（4）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%；

（5）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%；

（6）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；

（7）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（8）基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（9）本基金若参与股指期货交易，应当符合下列投资限制：

①本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

②本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。

其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

③本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

④本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

⑤本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指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 20%；

⑥每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

（10）本基金若参与国债期货交易，应当符合下列投资限制：

①本基金在任何交易日日终，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%；

②本基金在任何交易日日终，在扣除股指期货和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；

③本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%；

其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

④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%；

⑤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；

⑥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%；

（11）本基金若参与股票期权交易，应当符合下列投资限制：

①基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；

②开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权

所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

③未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

（12）本基金参与融资业务后，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

（13）本基金若参与转融通证券出借业务，应当符合下列投资限制：

①出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

②本基金参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

③最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

④证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

（14）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%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（15）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；

（16）本基金投资存托凭证的比例限制依照国内依法发行上市的股票执行，与国内依法发行上市的股票合并计算；

（17）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。

除第（6）、（13）、（14）、（15）项外，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，基金管理人应当在所涉证券可交易之日起 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。

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）向其基金管理人、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。

除标的指数成份股、备选成份股之外，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的原则，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（含三分之二）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。

3、法律法规或监管部门对基金合同所述投资比例、投资限制、组合限制、禁止行为等作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行。

（五）标的指数

本基金的标的指数为中证人工智能主题指数。

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，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。

尽管有前述约定，但若出现指数更名等对基金投资及基金份额持有人无实质性影响的标的指数变更情形，则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人与基金托管人协商一致后变更并在规定媒介上公告。

（六）业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中证人工智能主题指数收益率。

1、业绩比较基准设定的原因

本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的标的指数为中证人工智能主题指数，相应选取中证人工智能主题指数作为基准要素。

综上，本基金选取的业绩比较基准与基金投资目标、投资范围、投资策略、投资比例限制相匹配。

2、业绩比较基准要素的基本信息

中证人工智能主题指数由中证指数有限公司编制发布，指数代码为 930713，具体信息详见中证指数有限公司网站，网址：https://www.csindex.com.cn。

3、业绩比较基准的计算方法

本基金业绩比较基准收益率的计算方法以每日收益率为基础，以时间加权为计算原则。

法律法规、监管机构、登记机构、证券交易所和自律规则另有规定的，从其规定。

4、管理投资偏离业绩比较基准的定性或定量方法

本基金为实现投资目标，按照约定的投资策略构建投资组合，对基金实际投资与业绩比较基准的偏离进行管理与控制。如因发生风险因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过投资目标所述范围时，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。

5、未来可能变更业绩比较基准的情况和程序

本基金的业绩比较基准的要素与标的指数一致，相关变更情形和程序详见本章“（五）标的指数”部分内容。

若本基金调整业绩比较基准的要素权重，本基金将根据法律法规、中国证监会的规定和基金合同约定履行相关程序。

（七）风险收益特征

本基金属于股票型基金，一般情况下，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。

（八）基金管理人代表基金行使股东或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股东或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、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。

十一、基金的财产

（一）基金资产总值

基金资产总值是指基金持有的各类有价证券、银行存款本息和基金应收款以及其他投资所形成的价值总和。

（二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（三）基金财产的账户

基金托管人或基金管理人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立基金财产的托管账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金服务机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

（四）基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人、基金服务机构和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金服务机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和基金合同的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

十二、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

基金所拥有的股票、债券和银行存款本息、应收款项、资产支持证券、股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约、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。

（四）估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票等），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）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，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）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，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；

（4）交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票、债券，采用估值技术确定公允价值；

（3）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照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估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照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估值。对银行间市场未上市，且第三方估值基准服务机构未提供估值价格的债券应采用估值技术确定公允价值。

4、对于含投资人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采用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估值。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。

5、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。

6、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。

7、本基金投资股指期货、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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

本基金投资股票期权，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。

8、本基金参与融资和转融通证券出借业务，按照相关法律法规和行业协会的相关规定

进行估值。

9、本基金投资同业存单，按估值日第三方估值基准服务机构提供的估值全价估值；选定的第三方估值基准服务机构未提供估值价格的，应采用估值技术确定公允价值。

10、本基金投资存托凭证的估值核算，依照国内依法发行上市的股票执行。

11、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价格估值。

12、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。

基金管理人担任本基金的会计责任方，负责本基金净值计算和基金会计核算。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，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

（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，由此产生的损益计入基金财产。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。国家另有规定的，从其规定。

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，由基金管理人按照规定对外公布。

（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。

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，或投资人自身的原因造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，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。

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，则有协助义务的当事人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。

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，通报基金托管人并报中国证监会备案。

（3）如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

5、特殊情况的处理

（1）基金管理人或基金托管人按基金合同约定的估值方法进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

（2）由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、指数编制机构、第三方估值基准服务机构、证券经纪商或证券登记结算机构等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策、市场规则变更等非基金管理人或基金托管人原因，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，仍未能发现错误或因前述原因未能避免或更正错误的，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减轻或消除由此造成的影响。

（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、法律法规规定、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，由基金管理人按照《信息披露办法》的规定进行披露。

十三、基金的收益与分配

（一）基金收益分配原则

1、每份基金份额享有同等分配权；

2、若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

3、本基金收益分配采取现金方式；

4、基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率时，基金管理人可以进行收益分配；在符合有关基金收益分配条件的前提下，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的公告为准；

5、基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（二）基金累计报酬率及标的指数同期累计报酬率的计算方式

在收益评价日，基金管理人计算基金累计报酬率和标的指数同期累计报酬率。

基金累计报酬率为收益评价日基金份额净值（如上市后基金份额发生折算，则采用剔除上市后折算因素的基金份额净值）与基金上市前一交易日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%；

剔除上市后折算因素的基金份额净值$=\frac{基金资产净值}{基金份额总额}\times\prod_i 上市后第i次基金份额折算比例$

注：$\prod_i$ 为连乘符号。当基金份额折算比例为 N 时，表示每一份基金份额折算为 N 份。

标的指数同期累计报酬率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一交易日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%。

（三）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、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

（四）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。

（五）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。

十四、基金的费用与税收

（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、律师费和诉讼费或仲裁费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、因基金的证券、期货、期权交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金及其他类似性质的费用等）；

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、基金的上市初费和年费；

10、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 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.50%÷当年天数

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，经管理人授权，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，顺延至最近可支付日支付。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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 0.10%年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.10%÷当年天数

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，经管理人授权，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，顺延至最近可支付日支付。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

3、除管理费、托管费之外的基金费用，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、指数许可使用费（指数许可使用费由基金管理人承担，不得从基金财产中列支）；

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

本基金支付给基金管理人、基金托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务机关的相关规定。

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，但本基金运作过程中应缴纳的增值税、附加税费等税费由基金财产承担，按照税务机关的要求以基金管理人名义缴纳。

十五、基金的会计与审计

（一）基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

（二）基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

十六、基金的信息披露

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、基金合同及其他有关规定。相关法律法规或监管机关就基金的信息披露做出新的规定或予以调整的，本基金按照其最新规定执行，无需基金份额持有人大会审议批准。

（二）信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及符合《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2、对证券投资业绩进行预测；

3、违规承诺收益或者承担损失；

4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6、中国证监会禁止的其他行为。

（四）本基金公开披露的信息应采用中文文本。同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

（五）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

A 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

1、基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会

召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当按照法律法规和监管要求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。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。基金合同生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在规定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要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产品资料概要。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人应当按照《信息披露办法》的规定，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规定网站上。

B 基金份额发售公告

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按照《信息披露办法》的规定登载于规定媒介上。

C 基金合同生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日按照《信息披露办法》的规定在规定媒介上登载基金合同生效公告。

D 基金净值信息

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通

过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

E 申购赎回清单

在开始办理基金份额申购或者赎回之后，基金管理人应当在每个开放日，通过规定网站、申购赎回代理券商或其他媒介公告当日的申购赎回清单。

F 基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易的，基金管理人应当在基金份额上市交易的三个工作日前，将基金份额上市交易公告书登载在规定网站上，并将基金份额上市交易公告书提示性公告登载在规定报刊上。

G 基金份额申购、赎回对价

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回对价的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或者营业网点查阅或者复制前述信息资料。

H 基金份额折算日公告、基金份额折算结果公告

基金合同生效后，本基金可以进行份额折算。基金管理人有权确定基金份额折算日，并提前公告。

基金份额进行折算并由登记结算机构完成基金份额的变更登记后，基金管理人应将基金份额折算结果公告登载于规定媒介上。

I 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

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《证券法》规定的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起十五个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

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。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

J 临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当依照《信息披露办法》的有关规定编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

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：

1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

2、基金终止上市交易、基金合同终止、基金清算；

3、本基金转换基金运作方式、与其他基金合并；

4、本基金更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，本基金改聘会计师事务所；

5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更基金管理人的实际控制人；

8、本基金募集期延长或提前结束募集；

9、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

13、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事项，中国证监会另有规定的情形除外；

14、本基金收益分配事项；

15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

17、本基金开始办理申购、赎回；

18、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

19、本基金变更标的指数；

20、基金份额停牌、复牌、暂停上市、恢复上市或终止上市交易；

21、本基金实施基金份额折算；

22、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

23、调整最小申购赎回单位、申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成；

24、调整基金份额类别的设置；

25、基金推出新业务或服务；

26、基金信息披露义务人认为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其他事项或中国证监会规定的其他事项。

K 澄清公告

在基金合同存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告基金上市交易的证券交易所。

L 基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

M 清算报告

发生基金合同终止事由的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并制作清算报告。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。

N 中国证监会规定应予公开披露的其他信息

若本基金投资股指期货、国债期货、资产支持证券、股票期权，参与融资及转融通证券出借业务，基金管理人将按相关法律法规要求进行披露。

当相关法律法规关于上述信息披露的规定发生变化时，基金管理人将按最新规定进行信息披露。

（六）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金净值信息、基金份额申购赎回对价、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在规定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，相关档案的保存期限不低于法律法规规定的最低年限。

（七）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

（八）暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息：

1、基金投资所涉及的证券、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

十七、风险揭示

（一）市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于货币市场工具，收益水平会受到利率变化的影响。

4、购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

5、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

（二）信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券违约，导致基金资产损失。

（三）管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

（四）操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT

系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

（五）合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

（六）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

标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

2、标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

3、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离，也可能使基金的跟踪误差控制未达约定目标：

（1）由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差。

（2）由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

（3）成份股派发现金红利、新股市值配售收益将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

（4）由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差。

（5）由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

（6）在基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对基金的收益产生影响，从而影响基金对标的指数的

跟踪程度。

（7）其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

4、标的指数变更的风险

尽管可能性很小，但如出现标的指数变更的情形，本基金基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与变更后的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

5、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

6、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险

基金管理人或基金管理人委托的机构在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考净值（IOPV），并按照相关规定发布，供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算还可能出现错误，投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

7、退市风险

因基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

8、投资者申购失败的风险

基金的申购赎回清单中，可能仅允许对部分成份股使用现金替代，且设置现金替代比例上限，因此，投资者在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股，导致申购失败的风险。

9、投资者赎回失败的风险

投资者在提出赎回申请时，如基金组合中不具备足额的符合要求的赎回对价，可能导致赎回失败。

基金管理人可能根据基金运作情况、市场变化以及投资者需求等因素调整最小申购赎回单位，由此可能导致投资者按原最小申购赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按

照新的最小申购赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

10、基金份额赎回对价的变现风险，即流动性风险

基金赎回对价主要为组合证券，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资者变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险，即流动性风险。

（1）本基金的申购、赎回安排

投资人在开放日的开放时间办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

（2）拟投资市场及资产的流动性风险评估

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，经考察中证人工智能主题指数的成份股数量、日均成交量以及日均成交金额，该指数将具有充足的流动性可满足本基金投资的要求；本基金在组合构建过程中，将根据开放日申购和赎回情况，决定投资标的指数成份股及备选成份股的时间和方式。一般情况下，上述投资标的流动性较好，但不排除在特定阶段、特定市场环境下特定投资标的出现流动性较差的情况，如因成份股流动性严重不足等特殊情形导致基金无法完全投资于成份股时，基金管理人将根据市场情况，并结合经验判断，采取包括成份股替代策略等在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期有效控制本基金的流动性风险。

（3）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响：

本基金备用流动性风险管理工具包括但不限于暂停接受赎回申请、延缓支付赎回对价、暂停基金估值以及中国证监会认定的其他措施。

①暂停接受赎回申请或延缓支付赎回对价

占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，基金管理人应当延缓支付赎回对价或暂停接受基金赎回申请。暂停接受赎回申请、延缓支付赎回对价等工具的情形、程序见招募说明书“九、基金份额的申购、赎回”中“（九）暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形”的相关规定。

若本基金暂停赎回申请，投资者在暂停赎回期间将无法赎回其持有的基金份额。若本基金延缓支付赎回对价，赎回对价支付时间将后延，可能对投资者的资金安排带来不利影响。

②暂停估值

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。暂停基金估值的情形、程序见招募说明书“十二、基金资产估值”中“（七）暂停估值的情形”的相关规定。

若本基金暂停基金估值，一方面投资者将无法知晓本基金的基金份额净值，另一方面本基金将暂停接受申购赎回申请或延缓支付赎回对价，进而导致投资者无法申购或赎回本基金，或赎回对价支付时间将后延，可能对投资者的资金安排带来不利影响。

（4）对 ETF 基金投资人而言，ETF 可在二级市场进行买卖，因此也可能面临因市场交易量不足而造成的流动性问题，带来基金在二级市场的流动性风险。

11、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险

基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后可能存在基金份额净值低于面值的风险。

12、第三方机构服务的风险

基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：

（1）申购赎回代理券商因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资者申购赎回服务的风险。

（2）登记机构可能调整结算制度，如实施货银对付制度，对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

（3）证券交易所、登记机构、基金托管人、申购赎回代理券商及其他代理机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

13、指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定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，基金合同终止。因此，投资人将面临转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

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并实施前，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，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

14、成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时可能面临如下风险：

（1）基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

（2）停牌成份股可能因其权重占比、市场复牌预期等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平。

（3）在极端情况下，标的指数成份股可能大面积停牌，基金可能无法及时卖出成份股以获取足额的符合要求的赎回款项，由此基金管理人可能设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施，投资者将面临无法赎回全部或部分基金份额的风险。

15、采用证券经纪商交易结算模式的风险

本基金采用证券经纪商交易结算模式，即本基金将通过基金管理人选定的证券经纪商进行场内交易，并由选定的证券经纪商作为结算参与人代理本基金进行结算，该种交易结算模式可能存在信息系统风险、操作风险、效率降低风险、交易结算风险、投资信息安全保密风险等风险。

（七）投资于股指期货的特定风险

本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，具备一些特有的风险点。投资股指期货主要存在以下风险：

1、市场风险：是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。

2、流动性风险：是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。

3、基差风险：是指股指期货合约价格和指数价格之间的价格差的波动所造成的风险，以及不同股指期货合约价格之间价格差的波动所造成的期现价差风险。

4、保证金风险：是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

5、信用风险：是指期货经纪公司违约而产生损失的风险。

6、操作风险：是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。

（八）投资于股票期权的特定风险

股票期权价格主要受到标的资产价格水平、标的资产价格波动率、期权到期时间、市场利率水平等因素的影响。因此，投资股票期权主要存在 Delta 风险、Gamma 风险、Vega 风险、Theta 风险以及 Rho 风险。同时，进行股票期权投资还面临流动性风险、信用风险、操作风险等。

（九）投资于国债期货的特定风险

本基金可投资于国债期货，可能引发如下风险：国债期货交易采用保证金交易方式，基金资产可能由于无法及时筹措资金满足建立或者维持国债期货头寸所要求的保证金而面临保证金风险。同时，该潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险。另外，期货在对冲市场风险的使用过程中，基金资产可能因为国债期货合约与合约标的价格波动不一致而面临基差风险。

（十）融资及转融通证券出借业务的风险

基金参与融资业务，在放大收益的同时也放大了风险。类似于期货交易，融资业务在交易过程中需要全程监控其担保金的比例，以保证其不低于所要求的维持担保比率，这种“盯市”的方式对本基金流动性的管理提出了更高的要求。

基金参与转融通证券出借业务的风险，包括但不限于：

1、流动性风险：当基金资产面临大额赎回时，可能因证券出借原因发生无法及时变现、支付赎回对价的风险。

2、信用风险：证券出借对手方可能无法及时归还证券、无法支付相应权益补偿及借券费用的风险。

3、市场风险：证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险。

（十一）投资于资产支持证券的风险

1、利率风险

市场利率将随宏观经济环境的变化而波动，利率波动可能会影响优先级资产支持证券持有人收益。如果采用固定利率结构，当市场利率上升时，资产支持证券的相对收益水平就会降低。

2、债务人或支付人的违约风险

资产支持证券偿付本金和收益的现金流来自于基础资产未来产生的现金流，即特定财

产权利的债务人未来偿付的本金及利息。若未来债务人未能履行相应义务，将导致基础资产损失。

3、流动性风险

资产支持证券中优先级资产支持证券可以通过中国证监会批准的流通方式进行流通。在交易对手有限的情况下，持有资产支持证券的本基金将面临无法在合理的时间内以公允价格出售资产支持证券而遭受损失的风险。

（十二）存托凭证的投资风险

本基金的投资范围包括存托凭证，如投资存托凭证，除与其他仅投资于境内市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

（十三）科创板投资风险

本基金可投资于科创板股票，将面临以下特殊风险：

（1）流动性风险

科创板设置较高投资者准入门槛，市场整体流动性可能弱于 A 股其他板块。若市场环境变化或机构投资者对标的形成一致性预期，可能导致基金持仓股票成交难度增加、交易成本上升，极端情况下存在无法及时变现的风险。

（2）退市风险

与 A 股其他板块相比，科创板执行更严格退市标准，退市流程更简洁高效，标的企业退市风险显著提升。若基金投资标的触发退市条件，可能导致其估值大幅缩水、流动性丧失，进而对基金资产净值造成不利影响。

（3）投资集中度风险

科创板上市公司多聚焦科技创新领域，属成长型企业，其商业模式、技术迭代风险、盈利能力、业绩波动等特征具有较强同质性。基金通过行业或风格分散投资降低风险的效果可能受限，若相关板块或行业面临系统性风险，标的股票价格集中波动可能导致基金资产净值

大幅波动。

（十四）创业板投资风险

本基金可投资于创业板股票，将面临以下特殊风险：

（1）盈利不及预期风险

创业板上市公司多以新技术、新模式、新业态为核心竞争力，普遍呈现轻资产运营模式，叠加技术迭代速度快、产业升级节奏快、商业模式易复制、业绩波动幅度大等特征，其上市后的持续创新能力、盈利稳定性和抗风险韧性均存在较大不确定性。因此，本基金投资于创业板相关企业，可能面临标的企业盈利不及预期、甚至导致基金资产遭受较大损失的风险。

（2）退市风险

注册制下，创业板退市制度更趋严格，退市指标涵盖财务类、交易类、规范类及重大违法类等多维度，且退市流程更简洁、退市效率更高。若本基金投资的创业板股票触发退市条件，可能导致股票流动性骤降、估值大幅缩水，进而影响基金资产净值。

（3）股价大幅波动风险

实施注册制后，创业板股票交易规则与 A 股主板存在差异，涨跌幅限制更为宽松：首次公开发行上市的创业板股票，上市后前 5 个交易日不设置涨跌幅限制，后续涨跌停幅度为 20%。同时，创业板股票上市首日即纳入融资融券标的范围。上述交易规则特点可能导致创业板股票波动幅度显著大于 A 股主板股票，存在大幅波动的风险。

（4）红筹企业及存托凭证相关风险

符合规定的红筹企业可在创业板上市。此类企业注册于境外，可能采用协议控制架构，其信息披露、分红派息及对投资者保护安排与境内上市公司存在差异。

红筹企业可发行股票或存托凭证（由存托人签发，以境外证券为基础在境内发行，代表境外基础证券权益）。存托凭证持有人享有的权益虽与境外基础证券持有人基本相当，但不等同于直接持有境外基础证券。投资者需充分知悉存托协议及相关规则，审慎评估相关投资风险。

（十五）其他风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金财产有遭受损失的风险。基金管理人、基金托管人、证券交易所、登记机构和销售机构等可能因不可抗力无法正常工作，从而影响基金的各项业务按正常时限完成。

十八、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，在履行适当程序后变更并公告。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自通过之日起生效，该决议应报中国证监会备案。信息披露义务人应在决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

（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：自出现基金合同的终止事由之日起 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、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、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《证券法》规定的注册会计师、律师组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

4、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。

5、基金财产清算程序：

（1）基金财产清算小组成立后，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。

6、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、结算保证金相关规定等客观因素，清算期限相应顺延。

（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应及时公告；基金财产清算报告经符合《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。

（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，保存期限不低于法律法规规定的最低年限。

十九、基金合同内容摘要

（一）基金合同当事人的权利与义务

A. 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，即成为本基金的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。

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、基金托管人损害其合法权益的行为依法提起仲裁；

（9）法律法规或中国证监会或基金合同规定的其他权利。

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、业务规则以及基金管理人按照规定就本基金发布的相关公告；

（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）交纳基金认购款项和认购股票、应付申购对价及法律法规和基金合同所规定的费用；

（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）如实提供基金管理人或其销售机构依法要求提供的信息，并不时予以更新和补充；

（10）遵守基金管理人、证券交易所、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；

（11）配合基金管理人或销售机构开展反洗钱尽职调查，包括但不限于提供真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，准确、完整填报身份信息，如实提供与交易和资金相关的资料等。不得从事洗钱活动或者为洗钱活动提供便利；

（12）法律法规或中国证监会或基金合同规定的其他义务。

B.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）依据基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案；

（9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回申请；

（10）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使证券持有人权利，为基金的利益行使因基金财产投资所产生的其他权利；

（11）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金申请和办理融资、转融通证券出借等相关业务；

（12）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；

（13）选择、更换为本基金提供销售、支付结算、基金份额注册登记、估值、投资顾问、

法律、会计、证券经纪商等服务的机构并确定相关费率，对该等服务机构的相关行为进行监督和处理；

（14）在不违反法律法规、相关证券交易所及登记机构相关业务规则的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回和非交易过户及其他相关业务的业务规则；

（15）若本基金采用证券经纪商交易结算模式，即本基金将通过基金管理人选定的证券经纪商进行场内交易，并由选定的证券经纪商作为结算参与人代理本基金进行结算，则基金管理人、基金托管人须与选择的证券经纪商签订相关协议，约定证券经纪商应履行的相关交易结算和交易监控等职责；

（16）法律法规或中国证监会或基金合同规定的其他权利。

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）按照法律规定要求编制季度报告、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或有权机关另有要求外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但向审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

（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年限；

（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满未能达到基金的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人应当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，同时基金募集期间网下股票认购所冻结的股票予以解冻；

（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）按照《中华人民共和国反洗钱法》等有关反洗钱的法律法规和监管要求履行反洗钱义务；

（28）法律法规或中国证监会或基金合同规定的其他义务。

C.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，如发现基金管理人有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，为基金开设证券账户等投资所需账户、为基金办理证券交易资金清算；

（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）法律法规或中国证监会或基金合同规定的其他权利。

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和证券账户等投资所需账户，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或有权机关另有要求外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但向审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

（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、赎回对价的现金部分；

（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;如果基金管理人有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年限;

（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）按照《中华人民共和国反洗钱法》等有关反洗钱的法律法规和监管要求履行反洗钱义务;

（23）法律法规或中国证监会或基金合同规定的其他义务。

（二）基金份额持有人大会

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。就本部分所述基金份额持有人大会事宜，除法律法规另有规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的权利。

ETF 联接基金的基金合同生效后，鉴于本基金和 ETF 联接基金的相关性，ETF 联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的 ETF 联接基金的基金份额出席或者委派代表出席本基金的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，ETF 联接基金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，ETF

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 ETF 联接基金份额占 ETF 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。

ETF 联接基金的基金管理人不应以 ETF 联接基金的名义代表 ETF 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 ETF 联接基金的特定基金份额持有人的委托以 ETF 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。

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

A 召开事由

1、除法律法规或中国证监会或基金合同另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当依据基金合同约定的相关程序召开基金份额持有人大会：

（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；

（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）终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的情形除外；

（11）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（12）法律法规或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、尽管有前述约定，但属于以下情况之一的，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）在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，调整本基金的申购费率或变更收费方式、调整本基金的基金份额类别的设置；

（3）因相应的法律法规、深圳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变化；

（5）基金管理人、登记机构、销售机构在法律法规和中国证监会规定范围内调整有关基金认购、申购、赎回、非交易过户等业务的规则；

（6）在不违反法律法规的情况下，调整基金的申购赎回方式和/或申购对价、赎回对价组成；

（7）对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金推出新业务或服务；

（8）监管机关或证券交易所要求或决定本基金终止上市；

（9）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。

B 会议召集人及召集方式

1、本基金基金份额持有人大会不设日常机构。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开时，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%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）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、基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

C 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至少 30 日，按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告会议通知。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、书面表决意见送达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书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

D 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审议事项的表决意见以书面形式或大会公告载明的其他方式在收取表决意见截止时间以前送达召集人指定的地址。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）到指定地点对书面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统计基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参与书面表决意见统计的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，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）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见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书面意见或授权他人代表出具书面意见；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面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应符合法律法规、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，基金份额持有人大会可通过网络、电话、短信或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信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。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

E 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为本部分“A 召开事由”中所述应由基金份额持有人大会审议决定的事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有议事内容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 G 条规定程序确定和公布计票人，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，首先由召集人在收取会议审议事项书面表决意见截止时间前至少提前 30 日公布提案，在所通知的收取表决意见截止日期后 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。

F 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投资者视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面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，但应当计入出具书面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。

G 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人士共同担任计票人；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计票人。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）计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要求对所投票数进行重新清点。计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人士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，并由公证机关对计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

H 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。该表决通过之日为基金份额持有人大会计票完成且计票结果符合法律法规和基金合同规定的决议通过条件之日。

基金份额持有人大会决议生效后应按照《信息披露办法》的规定在规定媒介上公告。

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。

I 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，基金管理人经与基金托管人协商一致，履行适当程序并提前公告后，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）基金合同的变更、终止与基金财产的清算

A 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，在履行适当程序后变更并公告。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自通过之日起生效，该决议应报中国证监会备案。信息披露义务人应在决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

B 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。

C 基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现基金合同的终止事由之日起 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、在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3、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《证券法》规定的注册会计师、律师组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

4、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。

5、基金财产清算程序：

（1）基金财产清算小组成立后，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。

6、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、结算保证金相关规定等客观因素，清算期限相应顺延。

D 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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。

E 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。

F 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项应及时公告；基金财产清算报告经符合《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。

G 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，保存期限不低于法律法规规定的最低年限。

（四）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，各方当事人应尽量通过协商、调解解决。协商、调解不能解决的，任何一方均应当将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。仲裁费用由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

争议处理期间，各方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（为本基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区法律和台湾地区有关规定）管辖。

（五）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式一份外，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。

二十、基金托管协议的内容摘要

（一）基金托管协议当事人

A 基金管理人：嘉实基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

法定代表人：经雷

成立时间：1999 年 3 月 25 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字【1999】5 号

组织形式: 有限责任公司（外商投资、非独资）

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

B 基金托管人：东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市静安区永和路 118 弄东方环球企业中心 24 号楼 5 楼（基金托管部）

法定代表人：戴彦

成立日期：2000 年 3 月 7 日

基金托管业务资格批准机关：中国证监会

基金托管业务资格文号：证监许可〔2022〕1134 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：127 亿元人民币

存续期间：2000 年 3 月 7 日至无固定期限

（二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

A 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1.基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对下述基金投资范围、投资对象进行监督。

本基金将投资于以下金融工具：

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（包含主板、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。

《基金合同》已明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种，以便基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合《基金合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

2.基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资比例为：

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。

因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行法律法规或监管部门规定的适当程序并取得基金托管人同意后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

（2）根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

1）本基金投资于标的指数成份股、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%；

2）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%；

3）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%；

4）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%；

5）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%；

6）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；

7）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

8）基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

9）本基金若参与股指期货交易，应当符合下列投资限制：

①本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

②本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。

其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

③本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

④本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

⑤本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指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 20%；

⑥每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金；

10）本基金若参与国债期货交易，应当符合下列投资限制：

①本基金在任何交易日日终，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%；

②本基金在任何交易日日终，在扣除股指期货和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；

③本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货、国债期货合约价值与有价证券市值

之和，不得超过基金资产净值的 100%；

其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

④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%；

⑤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；

⑥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%；

11）本基金若参与股票期权交易，应当符合下列投资限制：

①基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；

②开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

③未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

12）本基金参与融资业务后，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

13）本基金若参与转融通证券出借业务，应当符合下列投资限制：

①出借证券资产不得超过基金资产净值的 30%，出借期限在 10 个交易日以上的出借证券应纳入《流动性风险管理规定》所述流动性受限证券的范围；

②本基金参与出借业务的单只证券不得超过基金持有该证券总量的 30%；

③最近 6 个月内日均基金资产净值不得低于 2 亿元；

④证券出借的平均剩余期限不得超过 30 天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

14）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%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

15)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；

16）本基金投资存托凭证的比例限制依照国内依法发行上市的股票执行，与国内依法发行上市的股票合并计算；

17）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。

除第 6）、13）、14）、15）项外，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，基金管理人应当在所涉证券可交易之日起 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。

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。

3.基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

（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）向其基金管理人、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。

4.法律法规或监管部门对基金合同所述投资比例、投资限制、组合限制、禁止行为等作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行。

5.基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金关联交易进行监督。

除标的指数成份股、备选成份股之外，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的原则，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（含三分之二）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。

如法律、法规或《基金合同》有关于基金从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券清单。双方有责任确保向对方提供的关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。基金托管人仅按双方提供的基金关联方名单为限，进行监督。如果基金托管人在运作中严格遵循了监督流程，基金管理人仍违规进行关联交易，并造成基金资产损失的，由基金管理人承担责任。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

6.基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

本基金参与银行间市场交易，由基金管理人决定银行间市场交易对手的名单，并按照审慎的风险控制原则在该名单中约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手；基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，需按交易对手名单中约定的该交易对手所适用的交易结算方式进行交易。

基金托管人根据基金管理人提供的银行间债券市场交易对手名单进行监督。

由于交易对手的资信风险引起的损失，基金管理人应当负责向相关责任人追偿。基金托管人无过错的不承担由此引发的责任及损失。

7.基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，对基金银行存款业务进行监督。

基金管理人应当加强对基金投资银行存款风险的评估与研究，严格测算与控制投资银行存款的风险敞口，针对不同类型存款银行建立相关投资限制制度。对于基金投资的银行存款，由于存款银行发生信用风险事件而造成损失时，基金管理人有权要求相关责任人进行赔偿。如果基金托管人在运作过程中遵循有关法律法规的规定和《基金合同》、本协议的约定监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。

8.基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

如下所指“流通受限证券”与本协议以及基金合同所指“流动性受限资产”定义存在不同。就流动性受限资产定义，请参照基金合同的“第二部分 释义”部分。

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受

限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

（1）本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准或注册的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

（2）基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资流通受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失等问题的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票的相关流动性风险处置预案。

对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险，基金托管人无过错的不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失的，基金托管人不承担任何责任。

（3）基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会规定媒介披露所投资非公开发行股票的信息。法律法规有新规定的，从其规定。

有关基金投资的流通受限证券应保证登记存管在相关基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并保证基金托管人能够正常查询。

如基金管理人未遵守相关制度、流动性风险处置方案以及投资额度和比例限制要求，导致基金出现风险致使基金托管人承担赔偿责任的，若基金托管人此前已切实履行监督职责的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

（4）本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于执行投资指令之前将有关资料书面提交基金托管人，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

1）中国证监会批准或注册发行非公开发行股票的批准或注册文件。

2）有关非公开发行股票的发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

3）基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

4）本基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制

5)基金托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定，对基金管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。

（5）相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

B 基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担相应责任。

C 基金托管人应当对定期报告有关业绩比较基准的披露内容进行复核，包括业绩比较基准披露的财务指标、净值表现、投资组合信息等。

D 基金托管人应当对业绩比较基准的选取、变更进行监督。基金托管人在基金合同审核过程中，应当重点关注业绩比较基准的代表性和客观性。基金托管人发现业绩比较基准与本基金主要的投资目标、投资范围、投资策略、投资比例、投资风格不匹配的，应当及时提醒基金管理人。法律法规有最新要求的，按最新要求执行。

E 基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议等有关规定时，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

1.在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

2.基金管理人应积极配合和协助基金托管人依照法律法规、《基金合同》和本托管协议对基金业务的监督和核查，对基金托管人发出的书面提示，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，或就基金托管人的合理疑义进行解释或举证。对基金托管人按照法律法规、《基金合同》和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

3.若基金托管人发现基金管理人发出但未执行的投资指令或依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》或本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

4.对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》或本协议约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

5.基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取拖

延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。基金管理人违反法律法规或者违反《基金合同》或本协议约定而给基金财产或基金份额持有人造成的损失，由基金管理人承担。

（三）基金管理人对基金托管人的业务核查

基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、是否分别开设基金财产的托管账户和证券账户及投资所需其他账户、是否复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、是否根据基金管理人指令办理清算交收、进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、无故未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定时，基金管理人应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到通知后，应及时核对并以书面形式向基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正。

基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠基金管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金管理人进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。基金托管人违反法律法规或者违反《基金合同》或本协议约定而给基金财产或基金份额持有人造成的损失，由基金托管人承担。

（四）基金财产的保管

A 基金财产保管的原则

1.基金财产应独立于基金管理人、基金托管人、证券经纪商的固有财产。

2.基金托管人应按本协议规定安全保管托管财产。未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产（基金托管人主动扣收的汇划费及依据本协议扣划的管理费、托管费等费用除外）。基金托管人不对处于自身实际控制之外的账户及财产承担责任。

3.基金托管人按照规定为托管的基金财产开设和注销托管账户（即基金资产托管专户）和证券账户及投资所需其他账户。

4.基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他

基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。

5.对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人。到账日基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失;基金托管人对基金管理人的追偿行为应予以必要的协助与配合，但对基金财产的损失不承担责任，基金托管人存在过错的除外。

6.基金托管人对因为基金管理人投资产生的存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产，或交由期货公司或证券公司负责清算交收的基金资产（包括但不限于证券交易资金账户内的资金、证券类基金资产、期货保证金账户内的资金、期货合约等）及其收益，由于该等机构或该机构会员单位等本协议当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给基金资产造成的损失等不承担责任。

7.除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

B 募集资金的验证

募集期内销售机构按销售与服务代理协议的约定,将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的账户。该账户由基金管理人开立并管理。基金募集期满或基金管理人决定停止基金募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，由基金管理人聘请符合《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字方为有效。验资完成，基金管理人应将募集的全部资金和股票划入基金托管人为基金开立的托管账户和证券账户中，并确保划入的资金与验资金额相一致。基金托管人收到有效认购资金当日以书面形式确认资金到账情况，并及时将资金到账凭证提供至基金管理人，双方进行账务处理。

若基金募集期限届满，未能达到《基金合同》备案的条件，由基金管理人按规定办理退款、股票解冻及返还等事宜，基金托管人应予以必要的协助和配合。

C 基金资产托管专户的开立和管理

1.基金托管人以基金的名义在其营业机构开设资产托管专户,并根据基金管理人合法合规的有效指令办理资金收付。基金管理人应根据法律法规及基金托管人的相关要求，提供开户所需的资料并提供其他必要协助。本基金的资产托管专户的预留印鉴的印章由基金托管人刻制、保管和使用。

2.本基金除证券交易所场内交易和基金申赎过程中涉及的现金替代、现金差额、现金替代退补款以外的一切货币收支活动，均需通过基金托管人或基金的资产托管专户进行。基金的资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。除因本基金业务需要，基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用以基金名义开立的银行账户进行本基金业务以外的活动。

3.资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他有关规定。

D 基金证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

1.基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司开立专门的证券账户。

2.基金证券账户的开立和原始开户材料保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

3.基金管理人为基金财产在证券经纪机构开立证券交易资金账户，用于基金财产证券交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及场内证券交易清算，并与基金托管人开立的托管账户建立第三方存管关系。

4.基金证券账户和证券交易资金账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让本基金的任何证券账户；亦不得使用本基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

E 银行间市场债券托管和资金结算专户的开立和管理及市场准入备案

《基金合同》生效后，在符合监管机构要求的情况下，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以本基金的名义分别在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券交易的结算。基金托管人协助基金管理人完成银行间债券市场准入备案。

F 其他账户的开设和管理

1、因业务发展而需要开立的其它账户，可以根据《基金合同》或有关法律法规的规定，经基金管理人和基金托管人协商一致后，由基金托管人负责为基金开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、法律、法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

G 基金投资银行存款账户的开立和管理

1.基金投资银行定期存款应由基金管理人与存款银行总行或其授权分行签订总体合作协议，并将资金存放于存款银行总行或其授权分行指定的分支机构。

2.存款账户必须以基金名义开立，账户名称为基金名称，存款账户开户文件上加盖预留印鉴及基金管理人公章。

3.本基金投资银行存款时，基金管理人应当与存款银行签订具体存款协议，明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式、账户管理等细则。

4.为防范特殊情况下的流动性风险，定期存款协议中应当约定提前支取条款。

5.基金所投资定期存款存续期间，基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核对的真实、准确。

H 基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的实物证券、银行定期存款存单对应的财产不承担保管责任。

I 与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件原则上分别由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应尽量持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、快递邮寄等方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门，保管期限不低于法律法规规定的最低年限。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供与合同原件核对一致的并加盖基金管理人公章的合同传真件或复印件或扫描件。未经双方协商一致，合同原件不得转移。

（五）基金资产净值计算和会计核算

A 基金资产净值的计算、复核的时间和程序

1.基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。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，由此产生的损益计入基金财产。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。国家另有规定的，从其规定。

2.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。每个工作日，基金管理人应对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日交易结束后计算当日的基金份额净值和基金资产净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人按规定对外公布。

3.基金管理人担任本基金的会计责任方，负责本基金净值计算和基金会计核算。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，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布，但基金托管人应及时提示基金管理人按照有关法律法规进行信息披露。

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。

B 基金资产估值

估值原则和估值方法应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《企业会计准则》及其他法律法规的规定的约定。

C 估值错误处理

1.当基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生差错时，视为基金份额净值错误；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；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，通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，按照基金合同和本协议约定的估值错误处理原则和程序进行处理。

2.当因基金管理人和基金托管人原因致使基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

（1）如采用本协议第七章“基金资产净值计算和会计核算”中估值方法进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成基金份额持有人损

失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，由基金管理人与基金托管人按照管理费率和托管费率的比例各自承担相应的责任；

（2）如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布。在基金托管人计算正确的情况下，由此给基金份额持有人和基金造成的直接损失，由基金管理人负责赔付，否则基金管理人与基金托管人按照管理费率和托管费率的比例各自承担相应赔偿责任。

（3）由于提供信息的一方提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由相关责任方负责赔付。

（4）如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

3.由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所、指数编制机构、第三方估值基准服务机构、证券经纪商或证券登记结算机构等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策、市场规则变更等非基金管理人或基金托管人原因，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，仍未能发现错误或因前述原因未能避免或更正错误的，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。但基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

4.基金管理人和基金托管人按基金合同约定的估值方法进行估值时，由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，不作为基金资产估值错误处理。

5.前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业另有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，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。

D 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．法律法规规定、中国证监会和《基金合同》认定的其他情形。

E 基金账册的建立

1.基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

2.经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金净值信息的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

F 基金定期报告的编制和复核

1.基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5个工作日内完成。

2.《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。基金管理人在季度结束之日起15个工作日内完成季度报告编制并公告；在会计年度半年终了后两个月内完成中期报告编制并公告；在会计年度结束后三个月内完成年度报告编制并公告。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。

3.基金管理人在每月结束后5个工作日内完成月度报告，在月度报告完成当日，以双方约定的方式将有关报告提供基金托管人复核；基金托管人在3个工作日内进行复核，并将复核结果按照约定方式及时通知基金管理人。基金管理人在每季度结束后7个工作日内完成季度报告，在季度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后7个工作日内进行复核，并将复核结果按照约定方式通知基金管理人。基金管理人在每半年结束后30日内完成中期报告，在中期报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后30日内进行复核，并将复核结果按照约定方式通知基金管理人。基金管理人在每年度结束后45日内完成年度报告，在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后45日内复核，并将复核结果按照约定方式通知基金管理人。

4.基金托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

5.基金托管人在对财务会计报告、月度报告、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，应当将复核结果通知基金管理人，以备有权机构对相关文件审核时提示。

（六）基金份额持有人名册的保管

基金管理人妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人应按照目前相关规则保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限不低于法律法规规定的最低年限。

在基金托管人编制中期报告和年度报告前，基金管理人应将每年 6 月 30 日、12 月 31 日的基金份额持有人名册送交基金托管人，文件方式可以采用电子或文档的形式并且保证其的真实、准确、完整。基金托管人应妥善保管，不得将持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途。

（七）争议解决方式

A 本协议适用中华人民共和国法律（为本协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区法律和台湾地区有关规定），并从其解释。

B 双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，双方当事人应尽量通过协商、调解解决。协商、调解不能解决的，任何一方均应当将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，仲裁各方当事人均具有约束力。仲裁费用由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

（八）基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

A 托管协议的变更与终止

1.托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突，并需经基金管理人、基金托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代理人签字（或盖章）确认。本协议约定事项如与法律法规、《基金合同》的规定相冲突的，应以法律法规及《基金合同》的规定为准。

2.基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

（1）《基金合同》终止；

（2）基金托管人解散、依法被撤销、破产或有其他基金托管人接管基金资产；

（3）基金管理人解散、依法被撤销、破产或有其他基金管理人接管基金管理权；

（4）发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

B 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.在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和本托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

3.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《证券法》规定的注册会计师、律师组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

4.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。

5.基金财产清算程序：

（1）基金财产清算小组成立后，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。

6.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、结算保证金相关规定等客观因素，清算期限相应顺延。

7.清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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。

8.基金财产按下列顺序清偿：

（1）支付清算费用；

（2）交纳所欠税款；

（3）清偿基金债务；

（4）按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）－（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

C 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《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。

D 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，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。

二十一、对基金份额持有人的服务

对本基金份额持有人的服务主要由基金管理人、发售代理机构、申购赎回代理券商提供。

以下是基金管理人提供的主要服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。

（一）产品讯息咨询服务

投资者如果想查询基金净值、相关公告、基金产品与服务等信息，可通过拨打基金管理人客户服务电话 400-600-8800（免长途话费）、（010）85712266，或登录本基金管理人网站（www.jsfund.cn）进行咨询、查询。

（二）客户投诉与建议受理服务

客户对我们工作的意见和建议，可通过客服热线、留言信箱、电子邮件或信函等方式向我们提出，对于普通投诉我们会在两天内予以回复，对于重大投诉的回复不超过 72 小时。

二十二、其他应披露事项

无

二十三、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金销售机构住所和基金上市交易的证券交易所，投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。基金管理人和基金托管人保证其所提供的文本的内容与所公告的内容完全一致。

二十四、备查文件

1、中国证监会准予嘉实中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；

2、《嘉实中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《嘉实中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件和营业执照；

6、基金托管人业务资格批件和营业执照。

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

嘉实基金管理有限公司

2026 年 11 月 9 日