

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

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：国金证券股份有限公司

注册登记人：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2025 年 7 月 17 日

公告日期：2025 年 7 月 14 日

目录

一、	重要声明与提示	1
二、	基金概览	2
三、	基金的募集与上市交易	3
四、	持有人户数、持有人结构及前十名持有人	5
五、	基金主要当事人简介	6
六、	基金合同摘要	12
七、	基金财务状况	12
八、	基金投资组合	13
九、	重大事件揭示	15
十、	基金管理人承诺	16
十一、	基金托管人承诺	16
十二、	基金上市推荐人意见	16
十三、	备查文件目录	17
附件：	基金合同摘要	18

一、 重要声明与提示

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

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅 2025 年 7 月 3 日刊登在中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）及广发基金管理有限公司网站（www.gffunds.com.cn）上的《广发上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

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，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，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，本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险，本基金的特定风险等。

由于本基金是交易型开放式指数基金，特定风险包括：标的指数回报与债券市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、申购和赎回限额的风险、基金份额赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、成份券违约的风险、成份券停牌的风险等。本基金主要投资于科技创新公司债券，可能面临因政府政策变化、行业景气度变化等影响因素所带来的风险。除此之外，本基金还面临投资特定品种（包括国债期货、信用衍生品等）的特有风险。

本基金属于债券型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金为指数型基金，采用抽样复制策略跟踪标的指数，其风险收益特征与标

的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。

本基金为交易型开放式指数基金（ETF），将在上海证券交易所上市。投资者投资于本基金前请认真阅读证券交易所及登记结算机构的相关业务规则，确保具备相关专业知识后方可参与本基金的申购、赎回及交易。投资者一旦认购、申购或赎回本基金，即表示对基金认购、申购和赎回所涉及的基金份额的证券变更登记方式以及申购赎回所涉及组合证券、现金替代、现金差额等相关的交收方式已经认可。

投资者认购本基金时需具有上海证券账户，但需注意，使用上海证券交易所证券投资基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资者需要使用上证 AAA 科技创新公司债券指数的成份券参与网下债券认购或基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户。

本基金以 1 元初始面值进行募集，在市场波动等因素的影响下，存在单位份额净值跌破 1 元初始面值的风险。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》、《基金产品资料概要》及《基金合同》，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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

二、 基金概览

- 1、基金名称：广发上证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金
- 2、场内简称：科创债基
- 3、扩位证券简称：科创债ETF广发
- 4、证券代码：511120
- 5、2025年7月10日基金份额总额：29,680,599.00份（折算后）
- 6、2025年7月10日基金份额净值：100.0055元（折算后）
- 7、本次上市交易份额：29,680,599.00份（折算后）
- 8、上市交易的证券交易所：上海证券交易所
- 9、上市交易日期：2025年7月17日

- 10、基金管理人：广发基金管理有限公司
- 11、基金托管人：国金证券股份有限公司
- 12、基金登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司
- 13、上市推荐人：湘财证券股份有限公司
- 14、一级交易商（即申购赎回业务代办证券公司）：

渤海证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国联民生证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰海通证券股份有限公司、国投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、江海证券有限公司、联储证券股份有限公司、南京证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券有限公司、万和证券股份有限公司、万联证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中金财富证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司等证券公司（排名不分先后）。

若有新增本基金的一级交易商，基金管理人将另行公告。基金管理人可根据情况变更一级交易商，并及时公告。

三、 基金的募集与上市交易

（一） 本基金募集情况

- 1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可（2025）1387号。
- 2、基金运作方式：交易型开放式。
- 3、基金合同期限：不定期。
- 4、发售方式：投资者可选择网上现金认购和网下现金认购2种方式。
- 5、发售日期：于2025年7月7日进行发售。其中，网上现金、网下现金的发售日期均为2025年7月7日。
- 6、发售价格：人民币1.00元。
- 7、发售机构
 - （1）网下现金发售直销机构广发基金管理有限公司。

(2) 网上现金发售代理机构

具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位。

(3) 网下现金发售代理机构：华泰证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有限公司等代销机构（以上排名不分先后，详见本基金相关公告）。

8、验资机构名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

9、募集资金总额及入账情况

本基金于2025年7月7日公开募集。经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本基金有效认购户数2,614户，网上现金申请净有效认购资金金额为人民币2,087,997,000.00元，经基金管理人计算并确认的有效认购资金在募集期间产生的利息计人民币40,599.94元（该部分利息将于季度结息后划入基金托管账户），计入基金财产，不折算为投资人基金份额。至此，网上现金申请确认的有效认购资金合计人民币2,087,997,000.00元，共折算成2,087,997,000.00份基金份额。本基金网下现金申请净有效认购资金金额为人民币879,995,500.00元，经基金管理人计算并确认的通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币68,444.01元，折算成基金份额计68,434.00份。至此，网下现金申请有效认购资金合计人民币880,063,944.01元，共折算成880,063,934.00份基金份额。上述网上现金申请确认的有效认购资金人民币2,087,997,000.00元和网下现金申请确认的有效认购资金人民币880,063,944.01元已于2025年7月10日转入在中国建设银行股份有限公司开立的托管账户。

在基金募集期内，广发基金管理有限公司的基金从业人员认购基金份额1,000.00份，其中高级管理人员、基金经理未持有本基金份额。广发基金管理有限公司未使用固有资金认购广发上证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金的份额。

10、募集备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《广发上证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》《广发上证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于2025年7月10日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

11、基金合同生效日：2025年7月10日

12、基金合同生效日的基金份额总额：按照每份基金份额面值1.00元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计2,968,060,934.00份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。

(二) 基金份额折算

根据《广发上证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》《广发

上证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金管理人确定2025年7月10日为本基金的基金份额折算日，本次基金份额折算前，本基金基金份额总额为2,968,060,934.00份，基金份额净值为1.0001元；本次基金份额折算后，本基金基金份额总额为29,680,599.00份，基金份额净值为100.0055元。

基金份额折算后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。除小数点尾数处理外，基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。

（三）基金上市交易

- 1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书〔2025〕158号。
 - 2、上市交易日期：2025年7月17日。
 - 3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
 - 4、场内简称：科创债基。
 - 5、扩位证券简称：科创债ETF广发。
 - 6、基金代码：511120。
- 投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。
- 7、本次上市交易份额：29,680,599.00份（折算后）。
 - 8、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、 持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至2025年7月10日，本基金份额持有人户数为2,614户，平均每户持有的基金份额为11,354.48份。

（二）持有人结构

截至2025年7月10日，本基金份额持有人结构如下：

个人投资者持有的基金份额为277,950.00份，占基金总份额的0.94%；

机构投资者持有的基金份额为29,402,649.00份，占基金总份额的99.06%。

（三）截至2025年7月10日，前十名基金份额持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占基金份额的比例
----	-----------	-----------	----------

1	中信信托有限责任公司—中信信托信益 5 号证券投资集合资金信托计划	5,000,000.00	16.85%
2	华泰证券股份有限公司	4,000,000.00	13.48%
3	申万宏源证券有限公司	2,999,990.00	10.11%
4	国信证券股份有限公司	2,000,000.00	6.74%
5	中国银河证券股份有限公司	2,000,000.00	6.74%
6	申万宏源证券—上海银行—申万宏源上农尊享 1 号集合资产管理计划	1,400,103.00	4.72%
7	长沙银行股份有限公司—长盈 28 天周期开放式净值型产品	1,400,103.00	4.72%
8	中金公司—杭州银行—中金瑞享 7 号集合资产管理计划	1,000,072.00	3.37%
9	长沙银行股份有限公司—长吉 15 个月周期开放式净值型理财产品	1,000,072.00	3.37%
10	建信信托有限责任公司—建信信托—华夏策略 3 号信托计划	1,000,072.00	3.37%

五、 基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1、公司概况

名称：广发基金管理有限公司

法定代表人：葛长伟

总经理：王凡

注册资本：14,097.8万元人民币

注册地址：广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室

设立批准文号：中国证监会证监基金字[2003]91号

工商登记注册的法人营业执照文号：914400007528923126

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

2、股东及其出资比例

股东名称	出资比例
广发证券股份有限公司	54.533%
烽火通信科技股份有限公司	14.187%
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	14.187%
广州科技金融创新投资控股有限公司	7.093%
嘉裕元（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	3.87%
嘉裕祥（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	2.23%
嘉裕禾（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	1.55%
嘉裕泓（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	1.19%
嘉裕富（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）	1.16%
合 计	100%

3、内部组织结构及职能

自成立以来，公司不断致力于健全公司治理结构，严格按照法律法规要求，建立组织架构健全、职能划分明晰、制衡监督有效、内部运作协调、激励约束合理的公司治理架构，保持公司规范运作，保护基金份额持有人利益。公司设置了健全、清晰的组织架构，并根据业务需要进行了合理的职能分工。

公司组织架构主要分为投研条线、市场条线和中后台条线。其中，投研条线包括主动权益、指数投资、量化投资、固定收益投资、国际投资、资产配置、宏观策略、行业研究等职能部门，负责按各自专业分工开展投资研究、投资管理工作。市场条线包括产品设计、零售业务、机构业务、互联网金融业务、养老金业务、战略与创新业务等职能部门，负责按各自所属客户群体开展产品设计、客户推广和客户服务等工作；中后台条线包括风险管理板块、业务支持板块和管理支持板块，上述板块包含相应职能部门，风险管理板块主要负责投资、产品与市场、运营方面的合规管理、内审稽核、投资风险管理及数据服务等工作，业务支持板块主要负责信息安全与运维、系统开发、数据平台研发、组合交易、会计与结算、注册登记等工作，管理支持板块主要负责规划研究、财务管理、人力行政等工作。

4、基金管理业务情况

经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，广发基金管理有限公司于2003年8月5日成立。公司及旗下子公司目前拥有公募基金管理、社保基金境内委托投资管理人、基本养老保险基金证券投资基金管理机构、特定客户资产管理、基金投资顾问、QDII、RQFII、QFII、QDLP、受托管理保险资金投资管理人和保险保障基金委托资产管理投资管理人等业务资格，是具备

综合资产管理能力与经验的大型基金管理公司。

公司坚持“专业创造价值、客户利益为上”的理念，致力成为多资产、多策略、多市场的领先全能资产管理机构，为投资者创造长期、稳定、可持续的回报，为我国资本市场的繁荣与发展贡献力量。

5、信息披露负责人：项军

咨询电话：020-83936666

6、截至2025年6月30日，广发基金管理有限公司总人数915人，其中博士学位26人、硕士学位642人和学士学位216人。

7、本基金基金经理

洪志先生，管理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。现任广发汇利一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2021年8月27日起任职)、广发均衡增长混合型证券投资基金基金经理(自2021年8月27日起任职)、广发景辉纯债债券型证券投资基金基金经理(自2021年10月25日起任职)、广发景宏债券型证券投资基金基金经理(自2022年5月11日起任职)、广发上海清算所0-4年央企80债券指数证券投资基金基金经理(自2022年7月11日起任职)、广发中债1-5年国开行债券指数证券投资基金基金经理(自2022年7月11日起任职)、广发添福90天持有期债券型证券投资基金基金经理(自2023年10月24日起任职)、广发汇阳三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2023年12月26日起任职)、广发民玉纯债债券型证券投资基金基金经理(自2023年12月26日起任职)、广发汇明一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2024年2月29日起任职)、广发深证基准做市信用债交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2025年2月13日起任职)、广发上证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2025年7月10日起任职）。曾任广发基金管理有限公司固定收益管理总部债券交易兼研究员、投资经理，广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2019年1月10日至2020年2月11日)、广发集裕债券型证券投资基金基金经理(自2019年1月10日至2020年2月11日)、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2019年1月10日至2020年2月11日)、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2019年5月21日至2021年1月27日)、广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2019年5月21日至2021年4月8日)、广发汇康定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2019年5月21日至2021年9月22日)、广发汇宏6个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2019年5月21日至2021年10月14日)、广发汇立定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2019年5月21日至2021年10月25日)、广发汇兴3个月定期

开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2019年1月10日至2022年7月11日)、广发汇吉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2019年4月10日至2023年1月10日)、广发民玉纯债债券型证券投资基金基金经理助理(自2023年5月25日至2023年12月26日)、广发汇阳三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理助理(自2023年11月1日至2023年12月26日)、广发汇荣三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2021年6月16日至2024年4月25日)、广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2021年10月14日至2024年10月15日)、广发政策性金融债债券型证券投资基金基金经理(自2022年11月3日至2024年12月30日)、广发汇佳定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2021年1月27日至2025年3月3日)。

（二）基金托管人

1、基金托管人概况

（1）基本情况

名称：国金证券股份有限公司（以下简称“国金证券”）

注册地址：四川省成都市东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号 13 楼

上海市浦东新区芳甸路 1088 号 18 楼

成立时间：1996 年 12 月 20 日

法定代表人：冉云

注册资本：37.12559510 亿元人民币

联系人：陈俐洁

联系电话：021-20527198-15217

国金证券股份有限公司（以下简称“国金证券”或“公司”）前身为成都证券，经中国人民银行批准，成立于 1990 年 12 月，公司目前是上证 380 指数、中证 500 指数、MSCI 新兴市场指数成份股，注册地在四川省成都市，是一家资产质量优良、专业团队精干、创新能力突出的上市证券公司。公司连续十年分类监管评级均为 A 类，最近三年（2022 年-2024 年）分类监管评级均为 A 类 AA 级。截至 2024 年年末，共下设 7 家分公司，76 家证券营业部，分布在全国 24 个省（直辖市、自治区）的重要中心城市，同时公司控股国金证券资产管理有限公司、国金期货有限责任公司、国金鼎兴投资有限公司、国金创新投资有限公司、国金道富投资服务有限公司、国金金融控股（香港）有限公司、国金基金管理有限公司，参股国金涌富资产管理有限公司。国金证券秉承“让金融服务更高效、更可靠”的使命，追求“成为举足轻重的金融服务机构”的企业愿景，遵循【客户至上】、【视人才为公司最重要的资本】、

【以开放的心态真诚沟通】、【团队合作】、【专业规范】、【持续优化】、【追求卓越】的核心价值观，致力于为客户提供证券交易、投资银行、资产管理、财富管理等全方位金融服务，将公司建设成为“治理健全、管理规范、业务精湛、资质齐备、技术领先”的国内证券行业具有一流竞争力和影响力的上市券商。

（2）主要人员情况

国金证券下设资产托管部，主要业务人员均具有 3 年以上托管从业经验，员工 34%为硕士研究生，分别拥有了经济师、会计师、注册会计师、律师等中高级专业技术职称及专业资格，专业背景覆盖了金融、会计、经济、法律、计算机等各领域，建立了一支经验丰富、服务高效、专业规范的业务团队。

（3）基金托管业务经营情况

国金证券于 2017 年 6 月 22 日取得证券投资基金托管资格，通过组建经验丰富的专业团队、搭建安全高效的业务系统，目前已为基金专户、资管计划及私募基金等提供了专业规范、高效稳健的托管服务。

2、基金托管人的内部控制制度

（1）内部控制目标

严格遵守国家法律法规、行业规章及公司内相关管理规定，加强内部管理，保证资产托管部业务规章的健全和各项规章的贯彻执行，通过定期稽核和不定期风险检查，有效地实现对各项业务风险的监控和管理，维护基金份额持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

（2）内部控制组织结构

国金证券董事会是公司全面风险管理的最高决策机构，董事会设立风险控制委员会；公司在经理层面设置风险管理委员会，作为公司风险管理的议事机构；专职内控部门包括分别独立行使风险管理职能的风险管理部、合规管理部、审计稽核部、法律事务部、计划财务部，以及总裁办公室、计划财务部、清算部、信息技术部门、人力资源部等履行其他相应风险管理职能的部门。资产托管部设置合规风控岗和稽核监控岗，负责制定本部门风险管理规章制度，分析报告部门整体风险管理状况，评估检查风险管理执行情况并提出改进建议，抓住要害环节和关键风险，牵头组织防范各项业务风险，监督风险薄弱环节的整改情况；同时部门设置风险评估处置及应急维稳小组，由资产托管部部门负责人、合规风控岗及各业务小组负责人组成，负责对重大风险事项进行评估、确定风险管理违规事项的处理意见、突发事件危机管理等事项。

（3）内部控制制度及措施

根据《基金法》、《运作办法》、《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，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《国金证券资产托管业务管理暂行办法》、《国金证券资产托管业务

证券投资基金会计核算办法》、《国金证券资产托管系统运维管理规定》、《国金证券资产托管业务信息隔离墙制度实施细则》、《国金证券资产托管业务资产保管操作规程》、《国金证券资产托管业务投资清算操作规程》、《国金证券资产托管业务投资监督操作规程》、《国金证券资产托管业务信息披露管理规程》、《国金证券资产托管业务突发事件与危机处理规程》、《国金证券资产托管业务内部控制与风险管理操作规程》、《国金证券资产托管业务内部稽核监控操作规程》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务管理制度化，技术系统完整独立，业务分工合理规范，有关信息披露由专人负责。基金托管人通过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；安全保管基金财产，保持基金财产的独立性；经营场所设置防盗门禁，并配备录音和录像监控系统；建立独立的资产托管运营系统并进行防火墙设置；实施严格的不相容岗位分离管理，重要岗位设置双人复核机制，建立严格有效的操作风险管理体系；深入进行职业道德教育，树立专业规范、内控优先的理念，培养全体员工的风险防范和保密意识；配备专门的稽核监控岗对基金托管业务运行进行内部稽核审查，以保证基金托管业务内部控制的有效性。

3、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《基金法》、《运作办法》等有关法律法规的规定及《基金合同》约定，制定投资监督标准与监督流程，对基金合同生效之后所委托资产的投资范围、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，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对于基金资产的核算、基金资产净值的计算、对各基金费用的提取与开支情况、基金申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

（2）监督程序

基金托管人发现基金管理人存在违反《基金法》、《运作办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，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。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。基金管理人对于基金托管人提示的违规事项未能及时纠正的，基金托管人可报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

（三）上市推荐人

公司名称：湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

法人：高振营

客服电话:95351

网址:www.xcsc.com

(四) 验资机构

会计师事务所：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

主要经营场所：中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

执行事务合伙人：付建超

电话：021- 6141 8888

传真：021- 6335 0003

经办注册会计师：江丽雅、林婷婷

联系人：江丽雅

六、 基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、 基金财务状况

(一) 基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

(二) 基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三) 基金资产负债表

截至公告日前两个工作日即2025年7月10日，本基金的资产负债表（未经审计）如下：

金额单位：人民币元

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
资 产：		负债：	
银行存款	2,968,184,613.22	短期借款	-
结算备付金	-	交易性金融负债	-
存出保证金	-	衍生金融负债	-
交易性金融资产	-	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	-	应付证券清算款	-
基金投资	-	应付赎回款	-

债券投资	-	应付管理人报酬	-
资产支持证券投资	-	应付托管费	-
贵金属投资	-	应付销售服务费	-
其他投资	-	应付投资顾问费	-
衍生金融资产	-	应交税费	-
买入返售金融资产	-	应付利息	-
债权投资	-	应付利润	-
其中：债券投资	-	递延所得税负债	-
资产支持证券投资	-	其他负债	1,114.29
其他投资	-	负债合计	1,114.29
应收证券清算款	-	所有者权益：	
应收股利	-	实收基金	2,968,060,934.00
应收申购款	-	未分配利润	163,164.87
递延所得税资产	-	所有者权益合计	2,968,224,098.87
其他资产	40,599.94		
资产总计	2,968,225,213.16	负债和所有者权益总计	2,968,225,213.16

注：报告截止日 2025 年 7 月 10 日，基金份额净值人民币 100.0055 元，基金份额总额 29,680,599.00 份。

八、 基金投资组合

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

截至公告日前两个工作日即 2025 年 7 月 10 日，广发上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金（本基金合同自 2025 年 7 月 10 日起生效，本报告期为 2025 年 7 月 10 日）的投资组合报告如下：

（一）报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,968,184,613.22	100.00
8	其他资产	40,599.94	0.00
9	合计	2,968,225,213.16	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

（三）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

（八）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、本基金本报告期末未持有股指期货。

2、本基金本报告期内未进行股指期货交易。

(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- 1、本基金本报告期末未持有国债期货。
2、本基金本报告期内未进行国债期货交易。

(十一) 投资组合报告附注

1、本基金本报告期末未持有证券，不存在本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、本基金本报告期末投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	40,599.94
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	40,599.94

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、 重大事件揭示

本基金以 2025 年 7 月 10 日为基金份额折算日进行了基金份额折算，详见 2025 年 7 月

11 日披露的《关于广发上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》及 2025 年 7 月 12 日披露的《关于广发上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告》。

十、 基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

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

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

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

十一、 基金托管人承诺

基金托管人就该基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

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

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

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

（四）基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会。

十二、 基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为湘财证券股份有限公司。上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：

广发上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金已符合上市要求, 我公司推荐其上市。

十三、 备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所, 投资者可在办公时间免费查阅。

(一) 中国证监会准予广发上证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金注册募集的文件

(二) 《广发上证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

(三) 《广发上证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

(四) 法律意见书

风险提示:

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分, 并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书(更新)和基金产品资料概要(更新)等基金法律文件, 全面认识基金产品的风险收益特征, 在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上, 根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标, 对基金投资作出独立决策, 选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则, 在投资者作出投资决策后, 基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险, 由投资者自行负责。

广发基金管理有限公司

2025 年 7 月 14 日

附件：基金合同摘要

一、基金合同当事人的权利与义务

（一）基金管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集资金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记、结算机构办理基金登记、结算业务并获得《基金合同》规定的费用；
- （10）依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；
- （11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （13）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；
- （14）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- （15）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户和收益分配等业务规则；
- （16）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(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，按有关规定计算并披露基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的对价，编制申购赎回清单；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、中期和年度基金报告；

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

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但应监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付投资人赎回对价；

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

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

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者

能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金托管人的权利与义务

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

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

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

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

(4) 根据相关市场规则，为基金开设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) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
- 2、根据《基金法》《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：
- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
 - (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
 - (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
 - (4) 除依据《基金法》《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
 - (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
 - (6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
 - (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但应监管机构、司法机关等有权机关的要求，或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外；
 - (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值；
 - (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、中期报告和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
 - (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于法律法规规定的最低期限；
 - (12) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
 - (13) 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；
 - (14) 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；

(15) 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；

(16) 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；

(17) 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和银行监管机构，并通知基金管理人；

(18) 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；

(19) 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；

(20) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(21) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金份额持有人

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

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) 依法申请赎回其持有的基金份额；

(4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；

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

(6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

(7) 监督基金管理人的投资运作；

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

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购款项或认购债券、申购对价、现金差额及法律法规和《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) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序规则

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

本基金的基金份额持有人大会不设立日常机构。

未来，若本基金推出本基金的联接基金，则：

鉴于本基金和本基金的联接基金（以下简称“联接基金”）的相关性，联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金的份额直接参加或者委派代表参加本基金的基金份额持有人大会表决。在计算参会份额和计票时，联接基金基金份额持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为：在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

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

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

金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

（一）召开事由

1、除法律法规、中国证监会、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，但根据法律法规的要求调整该等报酬标准的除外；

- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、范围或策略；
- （9）变更基金份额持有人大会程序；
- （10）基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- （11）单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

- （12）对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- （13）终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的情形除外；

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

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商一致，履行适当程序后修改，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）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- （3）因相应的法律法规、相关证券交易所或者登记结算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、相关证券交易所和登记结算机构在法律法规、基金合同规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、交易、转托管、非交易过户、收益分配等业务的规则；

（6）履行适当程序后，基金推出新业务或服务；

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

（8）在不违反法律法规的情况下，调整基金份额净值、申购赎回清单的计算和公告时间或频率；

（9）本基金的联接基金采取特殊申购或其他方式参与本基金的申购赎回；

（10）基金开通场外申购、赎回等相关业务；

（11）募集并管理以本基金为目标 ETF 的一只或多只联接基金、增设新的基金份额类别、减少基金份额类别或者调整基金份额类别设置、在其他证券交易所上市、开通跨系统转托管等业务；

（12）按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（二）会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

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

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

出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合；

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

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

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

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

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的

其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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

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

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

他人代表出具表决意见；

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

3、在法律法规及监管机构允许的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，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，法律法规及监管机构允许的前提下，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。

(五) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

（七）计票

1、现场开会

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

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

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在

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

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

2、通讯开会

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

（八）生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致报监管机关并提前公告后，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、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可依据基金相对业绩比较基准的超额收益率或基金的可供收益分配利润进行收益分配；

2、本基金的收益分配采取现金分红的方式；

3、若基金合同生效不满3个月，本基金可不进行收益分配；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规的规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后，可对上述基金收益分配原则进行调整并提前公告，无需召开基金份额持有人大会。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额、分配方式等内容。

（五）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。

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

四、与基金财产管理、运作有关费用的提取、支付方式与比例

（一）基金管理人的管理费

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

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（二）基金托管人的托管费

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

$$H=E\times 0.05\%\div \text{当年天数}$$

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，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

五、基金资产的投资方向和投资限制

（一）投资范围

本基金主要投资于标的指数（上证 AAA 科技创新公司债指数）成份券、备选成份券。本基金还可投资于其他债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、政府支持债券、政府支持机构债券、可分离交易可转债的纯债部分、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、货币市场工具、银行存款、同业存单、资产支持证券、债券回购、信用衍生品、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

在建仓完成后，本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，基金管理人履行适当程序后，对本基金的投资比例做出相应调整。

（二）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

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

（2）每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交

易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受前述限制；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的部分不受前述限制；

（5）基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

（6）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；

（7）本基金若参与国债期货交易，应当符合下列投资限制：

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%；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%；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；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%；

（8）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、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（9）本基金参与信用衍生品投资，需遵守下列限制：

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

（10）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除第（2）、（6）、（8）、（9）项规定的情形外，因证券或期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、标的指数成份券调整、标的指数成份券流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

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。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。

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

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

(一) 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。

(二) 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，通过其规定网站、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。

七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

（一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议生效后，该决议应当自通过之日起五日内报中国证监会备案，且自决议生效后两日内在规定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、出现标的指数不符合要求（因成份券价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的；
- 4、《基金合同》约定的其他情形；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

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

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

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

4、基金财产清算程序：

- （1）《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认;
- (3) 对基金财产进行估值和变现;
- (4) 制作清算报告;
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计, 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;
- (7) 对基金财产进行分配。

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

(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财产中支付。

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

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

(六) 基金财产清算的公告

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

(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, 保存期限不少于法律法规规定的最低期限。

八、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意, 因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议, 如经友好协商未能解决的, 任何一方均有权将争议提交广州仲裁委员会, 按照届时有效的仲裁规则进行仲裁, 仲裁地点为广州市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力, 仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间, 基金合同当事人应恪守各自的职责, 继续忠实、勤勉、尽责地履行基金

合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律（不含港澳台立法）管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式

《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。