兴业添益6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理变更公告

公告送出日期：2026年11月17日

1. 公告基本信息

基金名称	兴业添益6个月定期开放债券型证券投资基金
基金简称	兴业添益6个月定开债券
基金主代码	016023
基金管理人名称	兴业基金管理有限公司
公告依据	《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等
基金经理变更类型	兼有增聘和解聘基金经理
新任基金经理姓名	伍方方
离任基金经理姓名	倪侃

2. 新任基金经理的相关信息

新任基金经理姓名	伍方方			
任职日期	2026年11月16日			
证券从业年限	15年			
证券投资管理从业年限	8年			
过往从业经历	伍方方女士，硕士学位，15年证券投资管理经历，2010年12月至2017年12月主要在兴业银行资金营运中心担任交易员，从事人民币资金交易、流动性管理、债券借贷、同业存单发行与投资与交易、投资策略研究以及其他资产负债管理相关工作。2017年12月加入兴业基金管理有限公司，2018年5月28日至2021年12月17日担任兴业中短债债券型证券投资基金(原兴业14天理财债券型证券投资基金)的基金经理，2018年8月7日起担任兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金(原兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金)的基金经理，2019年2月14日起担任兴业福鑫债券型证券投资基金的基金经理，2020年12月23日起担任兴业丰利债券型证券投资基金的基金经理，2021年8月6日起担任兴业添利债券型证券投资基金的基金经理，2021年8月10日起担任中证兴业中高等级信用债指数证券投资基金的基金经理，2021年8月30日至2022年7月22日担任兴业增益五年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2023年9月8日起担任兴业嘉远债券型证券投资基金的基金经理，2023年11月15日起担任兴业裕华债券型证券投资基金的基金经理，2024年5月9日起担任兴业添盈债券型证券投资基金的基金经理，2024年6月13日起担任兴业180天持有期债券型证券投资基金的基金经理。			
其中：管理过公募基金的名称及期间	基金主代码	基金名称	任职日期	离任日期
	003430	兴业中短债债券型证券投资基金(原兴业14天理财债券型证券投资基金)	2018年5月28日	2021年12月17日
	005988	兴业纯债6个月定期开放债券型证券投资基金(原兴业纯债一年定期开放债券型证券投资基金)	2018年8月7日	—
	004140	兴业福鑫债券型证券投资基金	2019年2月14日	—
	002268	兴业丰利债券型证券投资基金	2020年12月23日	—
	001299	兴业添利债券型证券投资基金	2021年8月6日	—
	003429	中证兴业中高等级信用债指数证券投资基金	2021年8月10日	—
	002870	兴业增益五年定期开放债券型证券投资基金	2021年8月30日	2022年7月22日
	018829	兴业嘉远债券型证券投资基金	2023年9月8日	—
	003672	兴业裕华债券型证券投资基金	2023年11月15日	—
	020552	兴业添盈债券型证券投资基金	2024年5月9日	—
	016301	兴业180天持有期债券型证券投资基金	2024年6月13日	-
是否曾被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施	否			
是否已取得基金从业资格	是			
取得的其他相关从业资格	—			
国籍	中国			
学历、学位	硕士研究生学历、硕士学位			
是否已按规定在中国基金业协会注册/登记	是			

3 离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	倪侃
离任原因	公司安排
离任日期	2026年11月16日
转任本公司其他工作岗位的说明	继续担任兴业聚源混合型证券投资基金、兴业福慧债券型证券投资基金等基金的基金经理
是否已按规定在中国基金业协会办理变更手续	是

4. 其他需要说明的事项

本公司已按规定向中国基金业协会办理相应手续。

特此公告。

兴业基金管理有限公司
2026年11月17日

关于兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金变更为兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修改基金合同及托管协议的公告

兴业基金管理有限公司(以下简称"本公司")旗下的兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证监会2025年6月16日证监许可【2025】1270号《关于准予兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金注册的批复》进行募集，《兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金基金合同》(简称"《基金合同》")于2025年9月1日正式生效。

本公司旗下的兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金经中国证监会2026年4月9日证监许可【2026】771号《关于准予兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》进行募集，并于2026年11月4日成立运作。

为更好地满足投资者的投资需求，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》等法律法规的规定和《基金合同》的约定："若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金(ETF)，则基金管理人有权决定将本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改《基金合同》。此项调整经基金管理人与基金托管人协商一致，并依照《信息披露办法》的有关规定公告。"本公司经与本基金的基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称"托管人")协商一致后，决定自2026年11月18日起，将兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金变更为兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并据此修订《兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金基金合同》。具体事项公告如下：

一、变更为联接基金

兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金变更为兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金当日，本基金的登记机构将进行基金份额变更登记，即将"兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金A类基金份额"变更为"兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额"，A类基金份额的基金简称由"兴业上证科创板人工智能指数A"变更为"兴业上证科创板人工智能ETF联接A"；将"兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金C类基金份额"变更为"兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金C类基金份额"，C类基金份额的基金简称由"兴业上证科创板人工智能指数C"变更为"兴业上证科创板人工智能ETF联接C"。各类基金份额的基金代码保持不变。

自2026年11月18日起，兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金正式变更为兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金，《兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效，原《兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金基金合同》自同日起失效。

变更生效后，A类基金份额申购费率及赎回费率、C类基金份额的销售服务费率及赎回费率保持不变。对于本次变更前基金份额持有人持有的兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金基金份额，变更后，其原基金份额持有期将计入兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额的持有期。

前述变更不影响各类基金份额净值的计算。

二、关于法律文件的修订

根据上述方案，本公司经与托管人协商一致并履行适当程序后，就本次基金变更事项相应修改和补充了《兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金基金合同》、《兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金托管协议》(以下简称"《托管协议》")、《兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金招募说明书》(以下简称"《招募说明书》")。

本基金《基金合同》、《托管协议》的修订内容详见附件《兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金基金合同、托管协议修改前后文对照表》。

本基金管理人将于公告当日将修改后的《兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》、《兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》登载于公司网站及中国证监会基金电子披露网站，并根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定在本基金招募说明书、基金产品资料概要中对上述相关内容进行相应修改并公告。投资者欲了解基金信息请仔细阅读基金的基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件。

本公司可以在法律法规和基金合同规定范围内调整上述有关内容。本公告的解释权归本公司所有。

风险提示：

1、投资者可登录本公司网站(https://www.cib-fund.com.cn)和中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)，获取相关信息。

2、本公司承诺以诚实信用、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，在市场波动等因素的影响下，基金投资存在本金损失的风险。投资有风险，基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负担。投资者投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书、基金产品资料概要等法律文件，了解拟投资基金的风险收益特征，根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相匹配，并按照销售机构的要求完成风险承受能力与基金风险之间的匹配检验。

特此公告。

兴业基金管理有限公司
2026年11月17日

附件、兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金基金合同、托管协议修改前后文对照表

一、《基金合同》修改前后文对照表

章节	原文	修订后内容
第一部分前言	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称"《基金法》")、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称"《运作办法》")、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称"《销售办法》")、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称"《流动性风险管理规定》")、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》(以下简称"《指数基金指引》")和其他有关法律法规。 三、兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")注册。 中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。 本基金为股票指数型基金，投资者投资于本基金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。 六、本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过前述50%比例的除外。法律法规或监管机构另有规定的除外。	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》(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2号——基金中基金指引》、《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》(以下简称"《指数基金指引》")和其他有关法律法规。 三、兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称"本基金")由兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金变更而来。兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")注册。 中国证监会对兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。 本基金为ETF联接基金，通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现。投资者投资于本基金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。
第二部分释义	1、基金或本基金：指兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金 4、基金合同或本基金合同：指《兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金基金合同》及对本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《兴业上证科创板人工智能指数型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《兴业上证科创板人工智能指数型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《兴业上证科创板人工智能指数型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《兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金基金份额发售公告》 24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务 29、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户 30、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期 32、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月 33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限 40、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为 48、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 49、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和 53、基金份额的类别：本基金根据是否收取销售服务费以及认购、申购费用的差异，将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值 54、A类基金份额：指在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额 55、C类基金份额：指在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额	1、基金或本基金：指兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金，由兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金变更而来 4、基金合同或本基金合同：指《兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》及对本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《兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充 6、招募说明书：指《兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》及其更新 7、基金产品资料概要：指《兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金产品资料概要》及其更新 23、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务 28、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户 29、基金合同生效日：指《兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效日，原《兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金基金合同》自同一日起失效 31、存续期：指《兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金基金合同》生效至《兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》终止之间的不定期期限 38、目标ETF：指另一获中国证监会注册的交易型开放式指数证券投资基金(简称ETF)，该ETF的投资目标和本基金的投资目标类似，本基金主要投资于该ETF以求达到投资目标。本基金的目标ETF为兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金 39、ETF联接基金：指将绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作的基金，本基金是联接其所投资的目标ETF的ETF联接基金 47、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、投资目标ETF份额所得收益、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 48、基金资产总值：指基金拥有的目标ETF份额、各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和 52、基金份额的类别：本基金根据是否收取销售服务费以及申购费用的差异，将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值 53、A类基金份额：指在投资者申购时收取申购费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额 54、C类基金份额：指在投资者申购时不收取申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额
第三部分基金的基本情况	一、基金名称 兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金 二、基金的类别 股票型证券投资基金 四、基金的投资目标 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 五、基金的标的指数 上证科创板人工智能指数及其未来可能发生的变更 五、基金的最低募集份额总额和募集金额 本基金的最低募集份额总额为2亿份，基金募集金额不少于人民币2亿元。 六、基金份额发售面值和认购费用 本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。 本基金A类基金份额的具体认购费率按招募说明书及基金产品资料概要的规定执行。C类基金份额不收取认购费用。 八、基金份额的类别 本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中，在投资人认购、申购基金时收取认购费用、申购费用，并不再从本类基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资人认购、申购基金时不收取认购费用、申购费用，而是从本类基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。 …… 投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中公告。 九、未来条件许可情况下的基金模式转换 若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金(ETF)，则基金管理人有权决定将本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改《基金合同》。此项调整经基金管理人与基金托管人协商一致，并依照《信息披露办法》的有关规定公告。	一、基金名称 兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金 二、基金的类别 ETF联接基金 四、基金的投资目标 通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 五、基金的标的指数 本基金的标的指数为目标ETF的标的指数，即上证科创板人工智能指数 七、本基金与目标ETF的联系和差异 本基金为目标ETF的联接基金，二者既有联系也有区别。 本基金与目标ETF之间的联系：(1)两只基金的投资目标均为紧密跟踪业绩比较基准；(2)两只基金具有相似的风险收益特征；(3)目标ETF是本基金的主要投资对象。 本基金与目标ETF之间的区别：(1)在基金的投资方法方面，目标ETF主要采取复制法，直接投资于标的指数的成份股、备选成份股；而本基金则采取间接的方法，通过将绝大部分基金财产投资于目标ETF，实现对标的指数的紧密跟踪。(2)在交易方式方面，投资者既可以像买卖股票一样在交易所买卖目标ETF的基金份额，也可以按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单的要求申赎目标ETF；而本基金则像普通的开放式基金一样，投资者可以通过基金管理人及非直销销售机构按未知价法进行基金的申购与赎回。 本基金与目标ETF业绩表现仍可能出现差异。可能引发差异的因素主要包括：(1)法规对投资比例的要求。目标ETF作为一种特殊的基金品种，可将全部或接近全部的基金资产，用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，仍需将不低于基金资产净值5%的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券。(2)申购赎回的影响。目标ETF采取按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单要求进行申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金采取按照未知价法进行申赎的方式，大额申赎可能会对基金资产净值产生一定影响。 八、基金份额的类别 本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中，在投资人申购基金时收取申购费用，并不再从本类基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资人申购基金时不收取申购费用，而是从本类基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。 …… 投资者可自行选择申购的基金份额类别。有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中公告。
第四部分基金份额的发售 第四部分基金的历史沿革	一、基金份额的发售时间、发售方式、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3个月，具体发售时间见基金份额发售公告。 2、发售方式 通过各销售机构的基金销售网点公开发售，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人网站公示。 3、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。 二、基金份额的认购 1、认购费用 本基金A类基金份额在认购时收取认购费用，C类基金份额不收取认购费用。 本基金A类基金份额的认购费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。A类基金份额的认购费用不列入基金财产。 2、募集期利息的处理方式 有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。 3、基金认购份额的计算 基金认购份额具体的计算方法在招募说明书中列示。 4、认购份额余额的处理方式 认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。 5、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。认购申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资者的任何损失由投资者自行承担。 三、基金份额认购金额的限制 1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。 2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书或相关公告。 3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。 4、基金管理人可以对募集期间的本基金募集规模设置上限。募集期内超过募集规模上限时，基金管理人可以采用比例确认或其他方式进行确认，具体办法参见基金份额发售公告。 5、如本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的50%，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。 6、投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不得撤销。	兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金由兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金变更而来。兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金经中国证监会2025年6月16日证监许可【2025】1270号《关于准予兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金注册的批复》进行募集，《兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金基金合同》于2025年9月1日正式生效。 根据《兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金基金合同》的约定："若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金(ETF)，则基金管理人有权决定将本基金转换为该基金的联接基金，并相应修改《基金合同》。此项调整经基金管理人与基金托管人协商一致，并依照《信息披露办法》的有关规定公告。"2026年11月4日，基金管理人管理的兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金的基金合同正式生效。基金管理人经与基金托管人协商一致后，决定将兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金变更为兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并据此修订《兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金基金合同》。 自2026年11月18日起，兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金正式变更为兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金，《兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效，原《兴业上证科创板人工智能指数型证券投资基金基金合同》自同日起失效。
第五部分基金备案 第五部分基金的存续	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，基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于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，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。 二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式 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、在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息； 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。 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，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。 法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。	《兴业上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决。 法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。
第六部分基金份额的申购与赎回	一、申购和赎回场所 …… 六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、申购、赎回价格以申请当日收市后计算的各类基金份额净值为基准进行计算。本基金分为A类和C类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值。本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内(包括该日)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。 七、拒绝或暂停申购的情形 8、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形。 10、指数编制机构或指数发布机构因异常情况使指数数据无法正常计算、计算错误或发布异常时。 发生上述第1、2、3、5、6、7、10、11项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有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 ……	一、申购和赎回场所 基金管理人可根据目标ETF的规模限制、监管机构的相关规定等，对基金规模进行控制。 六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、申购、赎回价格以申请当日收市后计算的各类基金份额净值为基准进行计算。本基金分为A类和C类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值。本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内(包括该日)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。未来若市场情况发生变化，或目标ETF净值计算和发布时间发生变化，或根据实际需要，经履行适当程序，本基金可相应调整基金净值计算和公告时间或频率并提前公告。 七、拒绝或暂停申购的情形 8、所投资的目标ETF暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 9、所投资的目标ETF暂停申购、二级市场交易停牌，达到或接近申购上限，基金管理人认为有必要暂停本基金申购的情形。 发生上述第1、2、3、5、6、7、8、9、11项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有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 5、本基金的目标ETF暂停估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。 6、本基金的目标ETF暂停赎回或二级市场交易停牌，且基金管理人认为有必要暂停本基金赎回的。
第七部分基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所：福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼 …… 法定代表人：叶文煌 (二)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： (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； (16)在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资和非交易过户等的业务规则； 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办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜； (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； (8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格； (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； 二、基金托管人 (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： (4)根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户、协助提供开立期货业务相关账户及交易编码的基金托管人相关信息，为基金办理证券、期货交易资金清算； 三、基金份额持有人 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： …… 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： (4)交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 住所：福建省福州市鼓楼区湖东路154号中山大厦A座5层507室 …… 法定代表人：刘宗治 (二)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： (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目标ETF、其他证券所产生的权利； (16)在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资和非交易过户等的业务规则； 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办理基金份额的申购、赎回和登记事宜； (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、基金投资； (8)采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格； 二、基金托管人 (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： (4)根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户、协助提供开立期货业务相关账户及交易编码的基金托管人相关信息，为基金办理证券、期货、基金交易资金清算； 三、基金份额持有人 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： (9)按照本基金合同的约定参加或者委派代表参加目标ETF基金份额持有人大会并对目标ETF基金份额持有人大会审议事项行使表决权； 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： (4)交纳基金申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
第八部分基金份额持有人大会	一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规和中国证监会另有规定的除外： …… 2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： (7)基金管理人、登记机构、销售机构调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则； (8)本基金变更为跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金(ETF)的联接基金并相应修改《基金合同》； 九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定 ……	鉴于本基金是目标ETF的联接基金，本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额直接出席或者委派代表出席目标ETF基金份额持有人大会并表决。在计算参会份额和票数时，本基金的基金份额持有人持有的享有表决权的参会份额数和表决票数为：在目标ETF基金份额持有人大会的权益登记日，本基金持有目标ETF基金份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。本基金份额折算为目标ETF后的每一参会份额和目标ETF的每一参会份额拥有平等的投票权。若本基金启用侧袋机制且特定资产不包括目标ETF，则本基金的主袋账户份额持有人可以凭持有的主袋账户份额直接参加或者委派代表参加目标ETF基金份额持有人大会并表决。 本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标ETF的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托，以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标ETF的基金份额持有人大会并参与表决。 本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会的，须先遵照本基金《基金合同》的约定召开本基金的基金份额持有人大会，本基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会的，由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF基金份额持有人大会。 一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规和中国证监会另有规定的除外： (11)基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标ETF的基金份额持有人大会； 2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： (7)基金管理人、登记机构、销售机构调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则； (8)由于目标ETF交易方式发生重大变更、终止上市、基金合同终止、与其他基金进行合并等情形而变更基金投资目标、范围或策略； (9)按照本基金合同约定，由目标ETF的联接基金变更为直接投资目标ETF标的指数的指数基金； 九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定 本基金侧袋机制实施期间，如果目标ETF召开持有人大会，根据届时的特定资产是否包含目标ETF，分别确定本基金主侧袋账户关于目标ETF的表决权及相应表决票数。目标ETF持有人大会表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。
第十二部分基金的投资	一、投资目标 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 二、投资范围 本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要投资于标的指数的成份股及其备选成份股(均含存托凭证，下同)。此外，为更好地实现投资目标，本基金将适度投资于非标的指数成份股(包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、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相关规定)。 …… 本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 三、投资策略 1、大类资产配置策略 本基金按照上证科创板人工智能指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 2、股票投资策略 (1)股票投资组合构建 本基金采用完全复制标的指数的方法，按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合。由于跟踪组合构建与标的指数组合构建存在差异，若出现较为特殊的情况(例如成份股停牌、成份股流动性不足以及其他影响指数复制效果的因素)，本基金将采用替代性的方法构建组合，使得跟踪组合尽可能近似于全复制组合，以减少对标的指数的跟踪误差。本基金所采用替代法调整的股票组合应符合投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%的投资比例限制。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。 (2)股票投资组合的调整 本基金所构建的股票投资组合原则上根据上证科创板人工智能指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整，本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化，对其进行实时调整，以保证基金净值增长率与上证科创板人工智能指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。 1)定期调整 根据标的指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合及时进行调整。 2)不定期调整 A、当成份股发生配送股、增发、临时调入及调出等情形而影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合； B、根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数； C、根据法律法规的规定和基金合同的约定，成份股在标的指数中的权重因其他特殊原因发生相应变化的，本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整，力求降低跟踪误差。 在正常市场情况下，力争控制本基金的基金份额净值与业绩比较基准的收益率日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 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)本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的90%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%； (8)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%；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%；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；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%； (9)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%；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%；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%； (10)在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指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； 除上述(6)、(11)、(12)、(13)、(16)情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。 2、禁止行为 (4)买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外； 五、标的指数与业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为：上证科创板人工智能指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5% 本基金的标的指数为上证科创板人工智能指数，本基金投资范围规定投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%，现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，因此采用上证科创板人工智能指数收益率和银行活期存款利率(税后)加权的方法构建本基金的业绩比较基准。 未来若出现标的指数不符合要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。 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。 若基金标的指数发生变更，基金业绩比较基准随之变更，由基金管理人根据标的指数变更情形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，及时在规定媒介上公告。 六、风险收益特征 本基金为股票型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。 七、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；	一、投资目标 通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 二、投资范围 本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数的成份股及其备选成份股(均含存托凭证，下同)。此外，为更好地实现投资目标，本基金将适度投资于非标的指数成份股(包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货、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相关规定)。 …… 本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 三、投资策略 本基金为ETF联接基金，主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。 1、目标ETF投资策略 本基金投资目标ETF的方式如下：(1)申购、赎回方式：按照目标ETF法律文件约定的方式申购、赎回目标ETF。(2)二级市场方式：在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。 本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申购、赎回方式或二级市场方式进行目标ETF的投资。当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，基金管理人履行适当程序后，本基金也将作相应的变更或调整。 2、股票投资策略 本基金可投资于标的指数成份股、备选成份股，以更好的跟踪业绩比较基准。同时，在条件允许的情况下还可通过买入标的指数成份股、备选成份股来构建组合以申购目标ETF。因此对可投资于标的指数成份股、备选成份股的资金头寸，主要采取复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的个券时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，包括通过投资其他股票进行替代，以降低跟踪误差，优化投资组合的配置结构。 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)本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%； (8)本基金若参与期货业务，则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%；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及目标ETF总市值的20%；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；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%； (9)本基金若参与期货业务，则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%；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%；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%； (10)本基金若参与期货业务，则在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指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，有价证券指目标ETF、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； 除上述(1)、(6)、(11)、(12)、(13)、(16)情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETF申购/赎回/交易被暂停或交收延迟等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。 因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制、目标ETF申购、赎回、交易被暂停或交收延迟等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述第(1)项规定投资比例的，基金管理人应当在20个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形或本基金合同另有约定的除外。 2、禁止行为 (4)买卖除目标ETF以外的其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外； 五、标的指数与业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为：上证科创板人工智能指数收益率×95%+活期存款基准利率×5% 1、业绩比较基准设定的原因 本基金为目标ETF的联接基金，通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。鉴于本基金及目标ETF跟踪的标的指数均为上证科创板人工智能指数，故本基金相应选取标的指数作为业绩比较基准要素，并将对应要素权重设置为95%；同时选取活期存款基准利率作为流动性管理部分的业绩比较基准要素，其对应要素权重设置为5%。 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 上证科创板人工智能指数由中证指数有限公司编制发布，指数代码为950180，具体信息详见中证指数有限公司网站，网址：www.csindex.com.cn。 活期存款基准利率由中国人民银行发布，具体信息详见中国人民银行网站，网址：www.pbc.gov.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。本基金先分别计算业绩比较基准各构成要素的每日收益率，再按照预设权重比例计算当日业绩比较基准的日收益率，并连乘每日收益率。 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 未来若本基金标的指数变更，基金管理人在履行适当程序后，业绩比较基准将随之变更。 未来若出现标的指数不符合要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。 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。 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。 六、风险收益特征 本基金为ETF联接基金，目标ETF为股票型基金，其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。 七、基金管理人代表基金行使相关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相关权利，保护基金份额持有人的利益； 九、目标ETF发生相关变更情形时的处理 目标ETF出现下述情形之一的，本基金在履行适当程序后，将由投资于目标ETF的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金，无需召开基金份额持有人大会；若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数的指数基金，则本基金将本着维护投资者合法权益的原则，在履行适当程序后，选取其他合适的指数作为标的指数。相应地，基金合同中将删除关于目标ETF的表述部分，或将变更标的指数，届时将由基金管理人另行公告。 1)目标ETF交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现； 2)目标ETF终止上市； 3)目标ETF的基金合同终止； 4)目标ETF与其他基金进行合并； 5)目标ETF的基金管理人发生变更(但变更后的本基金与目标ETF的基金管理人相同的除外)； 6)中国证监会规定的其他情形。 若目标ETF变更标的指数，本基金将在履行适当程序后相应变更标的指数且继续投资于该目标ETF。但目标ETF召开基金份额持有人大会审议变更目标ETF标的指数事项的，本基金的基金份额持有人可出席目标ETF基金份额持有人大会并进行表决，目标ETF基金份额持有人大会审议通过变更标的指数事项的，本基金可不召开基金份额持有人大会相应变更标的指数并仍为该目标ETF的联接基金。
第十三部分基金的财产	一、基金资产总值 基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和。	一、基金资产总值 基金资产总值是指基金拥有的目标ETF份额、各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和。
第十四部分基金资产估值	二、估值对象 基金所拥有的股票、存托凭证、债券、银行存款本息、应收款项、股指期货合约、国债期货合约、资产支持证券及其它投资等资产及负债。 四、估值方法 …… 七、暂停估值的情形 …… 十、特殊情形的处理 1、基金管理人或基金托管人按本部分第四条有关估值方法规定的第9项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。	二、估值对象 基金所拥有的目标ETF份额、股票、存托凭证、债券、银行存款本息、应收款项、股指期货合约、国债期货合约、资产支持证券及其它投资等资产及负债。 四、估值方法 1、目标ETF基金份额的估值 本基金投资的目标ETF按照估值日目标ETF的基金份额净值估值，如该日目标ETF未公布净值，则按该目标ETF的最近公布的净值估值。如果基金管理人认为按上述基金份额净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协商后，按最能反映其公允价值的价格估值。 七、暂停估值的情形 4、基金所投资的目标ETF发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形时； 十、特殊情形的处理 1、基金管理人或基金托管人按本部分第四条有关估值方法规定的第10项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

(下转B54版)