（上接A10版）

二、上市交易的地点

深圳证券交易所

三、上市交易的时间

基金合同生效后六个月内，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，融通证券A份额与融通证券B份额将申请在深圳证券交易所上市交易。

在确定上市交易的时间后，基金管理人应依据法律法规规定在指定媒介上刊登基金份额《上市交易公告书》。

四、上市交易的规则

本基金在深圳证券交易所的上市交易需遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所交易规则》等有关规定，包括但不限于：

1、融通证券A份额与融通证券B份额以不同的交易代码上市交易，两类基金份额上市首日的开盘参考价为前一交易日两类基金份额的基金份额参考净值；

2、上市交易的基金份额实行价格涨跌幅限制，涨跌幅比例为10%，自上市首日起实行；

3、上市交易的基金份额买入申报数量为100份或其整数倍；

4、上市交易的基金份额申报价格最小变动单位为0.001元人民币；

5、上市交易的基金份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

五、上市交易的费用

基金份额上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

六、上市交易的行情揭示

基金份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额（参考）净值。

七、上市交易的注册登记

投资人T日买入成功后，注册登记机构在T日自动为投资人登记权益并办理注册登记手续，投资人自T＋1日（含该日）后有权卖出该部分基金；

投资人T日卖出成功后，注册登记机构在T日自动为投资人办理扣除权益的注册登记手续。

八、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照《基金法》相关规定和深圳证券交易所的相关规定执行。

九、相关法律法规、中国证监会及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，基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

十、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，基金管理人可以在履行适当的程序后增加相应功能。

十、 融通证券份额的申购与赎回

本基金的融通证券A份额、融通证券B份额不接受投资人的申购与赎回，只上市交易；本基金基金合同生效后，投资人可通过场内或场外两种方式对融通证券份额进行申购与赎回。

一、申购和赎回场所

投资人办理融通证券份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金销售业务资格且经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。投资人需使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所交易系统办理融通证券份额场内申购、赎回业务。

投资人办理融通证券份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。投资人需使用中国证券登记结算有限责任公司开放式基金账户办理融通证券份额场外申购、赎回业务。

投资人应当在基金管理人和场内、场外代销机构办理融通证券份额申购、赎回业务的营业场所或按基金管理人和场内、场外代销机构提供的其他方式办理融通证券份额的申购和赎回。本基金场内、场外代销机构名单将在基金管理人在招募说明书、基金份额发售公告或其他公告中列明。

基金管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。

若基金管理人或其指定的代销机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行申购与赎回。

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购、赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳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本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》的有关规定在指定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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申购，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。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在融通证券份额申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指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、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其融通证券份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即融通证券份额申购、赎回价格以申请当日收市后计算的融通证券份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即融通证券份额申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、场外赎回遵循“先进先出”原则，即基金份额持有人在场外销售机构赎回融通证券份额时按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回。

5、投资人通过深圳证券交易所交易系统办理融通证券份额的场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人交付申购款项，申购成立；注册登记机构确认基金份额时，申购生效。基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；注册登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的融通证券份额余额，否则所提交的申购、赎回申请不成立。

投资人办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购融通证券份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；注册登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人在提交赎回申请时，赎回成立；注册登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回申请成功后，基金管理人将在T＋7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

3、申购和赎回的申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金登记机构在T＋1日（包括该日）内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T＋2日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购的确认以注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。

五、申购和赎回的数量限制

1、投资者通过场外代销机构和直销机构网上直销申购融通证券份额，单笔最低申购金额（含申购费）为10元，各销售机构对申购限额及交易级差有规定的，以各销售机构的业务规则为准。通过直销机构直销网点申购融通证券份额，单笔最低申购金额（含申购费）为10万元，追加申购单笔最低金额（含申购费）为10万元。代销网点的投资者欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。

投资者通过场内销售机构申购融通证券份额，单笔申购申请的最低金额为50,000元。

投资者当期分配的基金收益转购融通证券份额时，不受最低申购金额的限制。

2、投资者可将其持有的全部或部分融通证券份额赎回，融通证券份额不设最低赎回份额和最低持有份额限制。

3、基金管理人可根据市场情况，调整申购、赎回份额的数量限制，调整前的2个工作日基金管理人必须在指定媒介上刊登公告。

4、基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

六、基金的申购费和赎回费

1、申购费率

本基金的申购费率由基金管理人决定，基金份额申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资人申购本基金份额时，需交纳申购费用，费率按申购金额递减。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

（1）场外申购费率

本基金对申购设置级差费率，同时区分普通客户申购和通过直销柜台申购的养老金客户。

上述养老金客户包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：

1）全国社会保障基金；

2）可以投资基金的地方社会保障基金；

3）企业年金单一计划以及集合计划；

4）企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司将在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。

普通客户指除直销柜台申购的养老金客户以外的其他客户。

普通客户场外申购融通证券份额的具体费率如下表：

认购金额（M）	申购费率
M<100万元	1.20%
100万元≤M<200万元	0.60%
200万元≤M<500万元	0.40%
M≥500万元	单笔1000元

通过基金管理人的直销柜台申购融通证券份额的养老金客户的申购费为每笔100元。

（2）场内申购费率

融通证券份额的场内申购费率由销售机构参照场外申购费率执行。

2、赎回费率

融通证券份额的场内赎回费率为0.50%。

融通证券份额的场外赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，具体费率如下：

认购金额（M）	赎回费率
T<1年	0.50%
1年≤T<2年	0.25%
T≥2年	0

注：1年指365天

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的25%应归基金财产，未归入基金财产的部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

从场内转托管至场外的融通证券份额，从场外赎回时，其持有期限从转托管转入确认日开始计算。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金申购费率。

七、申购和赎回的数额和价格

1、融通证券份额净值的计算，保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的融通证券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，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

融通证券份额净值计算公式如下：

T日融通证券份额的基金份额净值＝T日闭市后的基金资产净值／T日本基金的基金份额总数（包括融通证券份额、融通证券A份额和融通证券B份额）

2、申购份额的计算

（1）融通证券份额的场外申购和场内申购均采用金额申购的方式，申购金额包括申购费用和净申购金额。

当申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

净申购金额＝申购金额／（1＋申购费率）

申购费用＝申购金额－净申购金额

申购份额＝净申购金额／申购当日融通证券份额的基金份额净值

当申购费用为固定金额时，申购份数的计算方法如下：

申购费用＝固定金额

净申购金额＝申购金额－申购费用

申购份额＝净申购金额／申购当日融通证券份额的基金份额净值

场外申购份额计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。场内申购份额计算结果保留至整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例5：某投资者（普通客户）投资10万元通过场外申购融通证券份额，假设申购当日基金份额净值为1.050元且该笔申购按照100%比例全部予以确认，其对应申购费率为1.20%，则可得到的申购份额为：

净申购金额＝100,000／（1+1.20%）＝98,814.23元

申购费用＝100,000－98,814.23＝1,185.77元

申购份额＝98,814.23／1.050＝94,108.79份

即：投资者投资100,000元申购本基金，对应申购费率为1.20%，假设申购当日基金份额净值为1.050元，则可得到94,108.79份基金份额。

例6：某养老金客户通过直销柜台投资1000万元申购融通证券份额，假设申购当日基金份额净值为1.050元且该笔申购按照100%比例全部予以确认，则申购费用为100元，其可得到的申购份额为：

净申购金额＝10,000,000－100＝9,999,900.00元

申购份额＝9,999,900／1.050＝9,523,714.29份

即：养老金客户通过直销柜台投资1000万元申购融通证券份额，对应申购费为100元，假设申购当日基金份额净值为1.050元，则可得到9,523,714.29份基金份额。

例7：某投资者投资10万元通过场内申购融通证券份额，对应费率为1.2%，假设申购当日基金份额净值为1.050元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额＝100,000／（1+1.2%）＝98,814.23元

申购费用＝100,000－98,814.23＝1,185.77元

申购份额＝98,814.23／1.050＝94,108份（保留至整数位）

实际净申购金额＝94,108×1.050＝98,813.40 元

退款金额＝100,000－98,813.40－1,185.77＝0.83元

即投资人投资10万元通过场内申购融通证券份额，假设申购当日基金份额净值为1.050元，则可得到94,108份融通证券份额，申购费用为1,185.77元。

3、赎回金额的计算

融通证券份额的场外赎回和场内赎回均采用份额赎回的方式，赎回的计算公式为：

赎回总金额＝赎回份额×赎回当日融通证券份额的基金份额净值

赎回费用＝赎回总金额×赎回费率

赎回金额＝赎回总金额－赎回费用

以上计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例8：某投资者赎回10万份场外融通证券份额，持有期限为1.5年，对应的赎回费率为0.25%，假定赎回当日融通证券份额的基金份额净值为1.213元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额＝100,000×1.213＝121,300.00元

赎回费用＝121,300.00×0.25%＝303.25元

赎回金额＝121,300.00－303.25＝120,996.75元

即：投资者赎回10万份场外融通证券份额，持有期限为1.5年，假设赎回当日融通证券份额净值是1.213元，则其可得到的净赎回金额为120,996.75元。

例 9：某投资者赎回10万份场内融通证券份额，赎回费率为0.5%，假设赎回当日融通证券份额的基金份额净值为1.213元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额＝100,000×1.213＝121,300.00元

赎回费用＝121,300.00×0.50%＝606.50元

赎回金额＝121,300.00－606.50＝120,693.50元

即投资人赎回10万份场内融通证券份额，假设融通证券份额净值是1.213元，则其可得到的赎回金额为120,693.50元。

4、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，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管理人不能支付赎回款项。

2、证券/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。

3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。

4、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时。

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，或基金管理人认定的其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形（除第4项外）之一且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人，基金管理人及基金托管人不承担该退回款项产生的利息等损失。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并予以公告。

九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券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。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、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时，可暂停接受投资人的赎回申请。

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

十、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的融通证券份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额（包括融通证券份额、融通证券A份额和融通证券B份额，下同）的百分之十，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，对于场外赎回，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额（包括融通证券份额、融通证券A份额、融通证券B份额）的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日融通证券份额的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司相应规则进行处理；基金转换中转出份额的申请的处理方式遵照相关的业务规则及届时开展转换业务的公告。

（3）暂停赎回

融通证券份额连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过二十个工作日，并应当在指定媒介上予以公告。

3、巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并延期办理的，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式，在三个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上予以公告。

十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日立即向中国证监会备案，并在规定期限内在指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日融通证券份额的基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过1日但少于2周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应依照有关法律法规的规定在指定报刊和网站等媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近1个工作日融通证券份额的基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过2周，暂停期间，基金管理人应每2周至少刊登暂停公告1次。当连续暂停时间超过2个月的，基金管理人可以调整刊登公告的频率。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人依照有关法律法规的规定在指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个工作日融通证券份额的基金份额净值。

十二、基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办融通证券份额与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

十三、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

十一、基金的非交易过户、转托管、冻结与解冻

一、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福利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。

二、基金的注册登记、系统内转托管和跨系统转托管

1、基金份额的注册登记

（1）本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的融通证券份额，登记在注册登记系统中基金份额持有人开放式基金账户下；场内认购、申购的融通证券份额，或上市交易的融通证券A份额和融通证券B份额，登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下。

（2）登记在证券登记结算系统中的融通证券份额，可以直接申请场内赎回，暂不在深圳证券交易所上市交易，但可经基金份额持有人申请，按1:1的份额配比分拆为融通证券A份额和融通证券B份额后，在深圳证券交易所上市。

（3）登记在证券登记结算系统中的融通证券A份额和融通证券B份额在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回，但可按1:1的份额配比申请合并为融通证券份额的场内份额后，再申请场内赎回。

（4）登记在注册登记系统中的融通证券份额，既可以直接申请场外赎回，也可以在办理跨系统转托管后，转至证券登记结算系统，由基金份额持有人申请，按1:1的份额配比分拆为融通证券A份额和融通证券B份额，在深圳证券交易所上市。

2、系统内转托管

（1）系统内转托管是指基金份额持有人将持有的融通证券份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转登记的行为。

（2）基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理融通证券份额赎回业务的销售机构（网点）时，需办理已持有融通证券份额的系统内转托管。

（3）基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理融通证券份额场内赎回的会员单位（交易单元）、或变更办理融通证券A份额和融通证券B份额上市交易的会员单位（交易单元）时，需办理已持有基金份额的系统内转托管。

3、跨系统转托管

（1）跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的融通证券份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

（2）本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。

三、基金的冻结和解冻

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。

十二、基金份额的配对转换

本基金基金合同生效后，在融通证券A份额、融通证券B份额的存续期内，基金管理人将为基金份额持有人办理配对转换业务。

一、配对转换是指本基金的融通证券份额与融通证券A份额、融通证券B份额之间的配对转换，包括分拆和合并两个方面。

1、分拆

分拆指基金份额持有人将其持有的每2份融通证券份额的场内份额申请转换成1份融通证券A份额与1份融通证券B份额的行为。

2、合并

合并指基金份额持有人将其持有的每1份融通证券A份额与1份融通证券B份额申请转换成2份融通证券份额的场内份额的行为。

二、配对转换的业务办理机构

配对转换的业务办理机构见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

基金投资人应当在配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式办理配对转换。深圳证券交易所、基金注册登记机构或基金管理人可根据情况变更或增减配对转换的业务办理机构，并予以公告。

三、配对转换的业务办理时间

配对转换自基金合同生效后不超过6个月的时间内开始办理，基金管理人应在开始办理配对转换业务的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

配对转换的业务办理日为深圳证券交易所交易日（基金管理人公告暂停配对转换时除外），具体的业务办理时间见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。

若深圳证券交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

四、配对转换的原则

1、配对转换以份额申请。

2、申请分拆为融通证券A份额和融通证券B份额的融通证券份额的场内份额必须是偶数。

3、申请合并为融通证券份额的融通证券A份额与融通证券B份额必须同时配对申请，且基金份额数必须同为整数且相等。

4、融通证券份额必须申请进行分拆，须跨系统转托管为融通证券份额的场内份额后方可进行。

5、份额配对转换应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、基金注册登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

五、配对转换的程序

配对转换的程序遵循届时相关机构发布的最新业务规则，具体见相关业务公告。

六、暂停配对转换的情形

1、深圳证券交易所、基金注册登记机构、配对转换业务办理机构因异常情况无法办理配对转换业务。

2、基金管理人认为继续接受配对转换可能损害基金份额持有人利益的情形。

3、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情形之一且基金管理人决定暂停配对转换的，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停配对转换业务的公告。

在暂停配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复配对转换业务的办理，并依照有关规定在指定媒介上公告。

七、配对转换的业务办理费用

投资人申请办理配对转换业务时，配对转换业务办理机构可酌情收取一定的佣金，具体见相关业务办理机构公告。

八、深圳证券交易所、基金注册登记机构调整上述规则，本基金合同将相应予以修改，且此项修改无需召开基金份额持有人大会审议。

十三、基金的投资

一、投资目标

本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证全指证券公司指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。

二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、权证、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金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)。

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。

基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证全指证券公司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%，权证投资占基金资产净值的比例为0%－3%，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%。

三、投资策略

本基金采用完全复制法进行投资，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对投资组合进行相应调整。

当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为导致成分股的构成及权重发生变化时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因交易成本、交易制度、个别成分股停牌或者流动性不足等原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，力求降低跟踪误差。

本基金力争将融通证券份额净值增长率与同期业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内。

1、股票投资策略

（1）股票投资组合的构建

本基金在建仓期内，将按照标的指数各成份股的基准权重对其逐步买入，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金可采取适当方法，以降低买入成本。当遇到成份股停牌、流动性不足等其他市场因素而无法依指数权重购买某成份股及预期标的指数的成份股即将调整或其他影响指数复制的因素时，本基金可以根据市场情况，结合研究分析，对基金资产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

（2）股票投资组合的调整

本基金所构建的股票投资组合将根据标的指数成份股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中的投比例限制、申购赎回变动情况等变化，对其进行适时调整，以保证融通证券份额净值增长率与标的指数收益率间的高度正相关和跟踪误差最小化。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。由于受到各项持股比例限制，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金将会采用合理方法寻求替代。

1）定期调整

本基金股票组合根据标的指数对其成份股的定期调整而进行相应的定期跟踪调整。

2）不定期调整

根据指数编制规则，当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重新调整时，本基金将根据各成份股的权重变化进行相应调整；

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；

根据法律、法规规定，成份股在标的指数中的权重因其它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。

2、债券投资策略

本基金可以根据流动性管理需要，选取到期日在一年以内的政府债券进行配置。本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，判断债券市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

3、资产支持证券投资策略

基金管理人本着风险可控和优化组合风险收益的原则，投资于资产支持证券，以期获得稳定的收益。坚持价值投资理念，综合考虑信用等级、债券期限结构、分散化投资、行业分布等因素，制定相应的资产支持证券投资计划。根据信用风险、利率风险和流动性风险变化、把握市场交易机会，积极调整投资策略。

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%，其中投资于中证全指证券公司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%；

（2）保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（5）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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%；

（10）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；

（11）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；

（12）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（13）本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

（14）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。

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比例不符合上述规定投比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

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）向基金管理人、基金托管人出资；

（5）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；

（6）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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，遵循持有人利益优先原则，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。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制。

五、标的指数与业绩比较基准

1、标的指数

本基金的标的指数是中证全指证券公司价格指数。

如果标的指数被停止编制及发布，或标的指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致标的指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上有代表性更强、更适合投资的指数推出，本基金管理人可以依据审慎性原则和维护基金份额持有人合法权益的原则，经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，依法变更本基金的标的指数和投资对象，并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

由于上述原因变更标的指数，若标的指数变更涉及本系列基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。若标的指数变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人应与基金托管人协商一致后，报中国证监会备案，并在指定媒介上公告。

2、业绩比较基准

95%×中证全指证券公司价格指数收益率＋5%×银行人