（上接A38版）

交易规则》和《上海证券交易所开放式基金业务管理办法》等有关规定。

（三）上市交易的费用

基金份额上市交易的费用按照上海证券交易所有关规定办理。

（五）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

上市基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市等事项按照《基金法》和上海证券交易所的相关规定执行。具体情况见基金管理人届时相关公告。

（六）其他

1、相关法律法规、《业务规则》、中国证监会及上海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》可相应予以修改，此事项无须召开基金份额持有人大会审议。

2、若上海证券交易所、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，本基金可以增加相应功能，无需召开基金份额持有人大会审议。

3、在不违反法律法规及不损害基金份额持有人利益的前提下，本基金可以申请在包括境外交易所在内的其他交易场所上市交易，且无需召开基金份额持有人大会审议。

十、基金份额的申购与赎回

投资者可通过场外或场内两种方式对本基金的基础份额进行申购与赎回。在本基金存续期内，A类份额、B类份额只上市交易，不单独接受申购和赎回。

（一）基金投资者范围

个人投资者、机构投资者、合格境外机构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者。

（二）申购与和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。其中，场外基础份额的申购和赎回场所为基金管理人的直销网点及场外非直销销售机构的销售网点；场内基础份额的申购和赎回场所为具有基金销售业务资格，且经上海证券交易所及其指定的登记结算机构认可的会员单位。

具体的销售机构将由基金管理人在《招募说明书》或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

（三）申购和赎回的开放日及时间

1.开放日及开放时间

投资者在开放日办理基础份额的申购和赎回，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《基金合同》的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在《招募说明书》中载明或另行公告。

《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、其他特殊情况或根据业务需要，基金管理人有权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

基金管理人可根据实际情况依法决定基础份额开始办理申购的具体日期，基金管理人自《基金合同》生效之日起不超过3个月开始办理基础份额的赎回。

在确定基础份额的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础份额的申购或者赎回或者转换。投资者在《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结算机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

（四）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基础份额的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，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、基金份额持有人赎回基础份额时，除指定赎回外，遵循“先进先出”原则，即登记确认日期在先的基金份额先赎回，登记确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所使用的赎回费率；

5、投资者申购、赎回基础份额时，需遵守上海证券交易所和登记结算机构的相关《业务规则》。若相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或登记结算机构对申购、赎回业务等规则有新的规定，按新规定执行。

基金管理人可根据基金运作的实际情况依法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。

（五）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资者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。

2、申购和赎回的款项支付

投资者申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资者交付申购款项，申购成立；登记结算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；登记结算机构确认赎回时，赎回生效。基金份额持有人赎回申请成功后，基金管理人自接受基金份额持有人赎回申请之日（T日）起7个工作日内（T+7日，包括该日）支付赎回款项，但中国证监会另有规定的除外。在发生巨额赎回或《基金合同》载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

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，本基金登记结算机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资者应及时向销售机构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，则申购款项本金返还给投资者。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记结算机构的确认结果为准。对于申购申请及申购份额的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。在法律法规允许的范围内，基金管理人可根据业务规则，对上述业务办理时间进行调整并公告。

（六）申购与赎回的数额限制

1. 申购金额限制

投资者办理本基金场外申购时，通过场外非直销销售机构或本公司网上交易系统首次申购的单笔最低金额为100元人民币，追加申购单笔最低金额为100元人民币；通过本公司直销中心首次申购的单笔最低金额为50,000元人民币，追加申购单笔最低金额为1,000元人民币。各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，需同时遵循该销售机构的相关规定。场内申购时，每笔申购金额最低为50,000元人民币，超过50,000元的应为1元的整数倍（以上金额均含申购费）。

投资者可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

2. 赎回份额限制

基础份额持有人办理场外赎回时，每笔赎回申请的最低份额为100 份基金份额；基金份额持有人办理场内赎回时，每笔赎回申请的最低份额为100 份基金份额，同时赎回份额必须是整数份额。

基础份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔交易类业务（如赎回、基金转换、转托管等）导致单个交易账户的基金份额余额少于100 份时，余额部分基金份额必须一同赎回。

3. 基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额限制、当日申购金额限制，具体规定请参见《招募说明书》或相关公告。

4. 基金管理人有权规定本基金的总规模限额、当日申购金额限制，具体规定请参见《招募说明书》或相关公告。

5. 基金管理人可根据市场情况，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生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（七）申购、赎回的费率

1. 申购费率

本基金对通过基金管理人直销中心申购的特定投资群体与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率，对通过直销中心申购的特定投资群体实施特定申购费率。特定投资群体指全国社会保障基金、依法设立的基本养老保险基金、依法制定的企业年金计划筹集的资金及其投资运营收益形成的企业补充养老保险基金（包括企业年金单一计划以及集合计划），以及可以投资基金的其他社会保险基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户、经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可将其纳入特定投资群体范围。

（1）场外基础份额的申购费率

申购金额(元)	特定申购费率(特定投资群体)	申购费率(其他投资者)
M<100万	0.10%	1.0%
100万≤M<200万	0.06%	0.6%
200万≤M<500万	0.03%	0.3%
M≥500万	按笔固定收取1,000元/笔	

注:特定申购费率仅适用于通过基金管理人直销中心、以场外方式申购的特定投资群体。

（2）场内基础份额的申购费率比照非特定投资群体的场外基础份额申购费率执行。

（3）在申购费按金额分档的情况下，如果投资者多次申购，申购费适用单笔申购金额所对应的费率。

2. 赎回费用

场外基础份额的赎回费率与场内基础份额的赎回费率相同，具体如下：

持有期限(天)	赎回费率
0-364	0.50%
365-729	0.25%
730及以上	0.00%

3. 申购费用由基金申购投资者承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记结算等各项费用。

4. 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。赎回费总额的25%归基金财产，其余用于支付登记结算费等其他相关手续费。

5. 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有关规定在指定媒介上公告。

6. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金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，基金管理人可以对投资者开展不同的费率优惠活动。

（八）申购和赎回的数额和价格

1. 基础份额的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由基金财产承担。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，基金管理人可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

2. 申购份额的计算

申购金额包括申购费用和净申购金额。登记结算机构根据单次申购的实际确认金额确定每次申购所适用的费率并分别计算。

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/T日基础份额基金份额净值

当申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

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/T日基础份额基金份额净值

申购费用以四舍五入方式保留到小数点后两位。通过场外方式进行申购的，申购份额计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担；通过场内方式进行申购的，申购份额计算结果采用截尾法保留至整数位，不足1份部分对应的申购资金将返还给投资者。

举例说明一：

某投资者（特定投资群体）场外申购本基金100,000元，对应的申购费率为0.1%，假设申购当日基金份额净值为1.1100元，则可得到的申购份额为：

净申购金额＝100,000/（1+0.1%）＝99,900.10元

申购费用＝100,000－99,900.10＝99.90元

申购份额＝99,900.10／1.1100＝90,000.09份

即：该投资者场外申购100,000元本基金，可得到90,000.09份基金份额。

举例说明二：

某投资者场内申购本基金100,000元，对应的申购费率为1.0%，假设申购当日的基金份额净值为1.1100元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

净申购金额＝100,000／（1+1.0%）＝99,009.90元

申购费用＝100,000－99,009.90＝990.10元

申购份额＝99,009.90／1.1100＝89,198.11份

因场内申购份额计算结果采用截尾法保留至整数份，故投资者申购所得份额为89,198份，不足1份部分对应的申购资金将返还给投资者。具体计算公式为：

实际净申购金额＝89,198×1.1100＝99,009.78元

退款金额＝100,000－99,009.78－990.10＝0.12元

即：该投资者场内申购本基金100,000元，假设申购当日的基金份额净值为1.1100元，则其可得到89,198份基金份额，退款0.12元。

3. 基金赎回金额的计算

投资者在赎回基金份额时需缴纳一定的赎回费用。计算公式如下：

赎回费＝赎回份额×T日基金份额净值×赎回费率

赎回金额＝赎回份额×T日基金份额净值－赎回费

赎回金额单位为元，计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产享有或承担。

举例说明：

某投资者持有10,000份基础份额365天后（未满730天）决定从场外赎回，对应的赎回费率为0.25%，假设赎回当日的基金份额净值是1.1320元，则可得到的净赎回金额为：

赎回费用＝10000×1.1320×0.25%＝28.30元

净赎回金额＝10000×1.1320－28.30＝11,291.70元

即：该投资者持有10,000份基础份额365天后（未满730天）从场外赎回，假设赎回当日的基金份额净值是1.1320元，则可得到的净赎回金额为11,291.70元。

（九）申购与赎回的登记结算

1. 基础份额申购与赎回的登记结算业务按照登记结算机构的有关规定办理。正常情况下，投资者T日申购基金成功后，登记结算机构在T＋1日内为投资者登记权益并办理登记结算手续，投资者T＋2日起（含该日）有权赎回该部分基金份额。

2. 投资者T日赎回成功后，正常情况下，登记结算机构在T＋1日内为投资者扣除权益并办理相应的登记结算手续。

3. 登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对上述登记结算办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益。基金管理人最迟于开始实施前2个工作日在指定媒介上公告。

（十）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者的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作或基金管理人无法接受投资者的申购申请。

2、发生《基金合同》规定的暂停基金资产估值情况时。

3、证券交易场所交易时间非正常停市。

4、接受某笔或某些申购申请将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，或其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、因本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受申购可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时。

7、当一笔新的申购申请被确认成功，使本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时；或使本基金当日申购金额超过基金管理人规定的当日申购金额上限时；或该投资者累计持有的份额超过单个投资者累计持有的份额上限时；或该投资者当日申购金额超过单个投资者当日申购金额上限时。

8、基金管理人、基金托管人、登记结算机构、销售机构、支付结算机构等因异常情况导致基金销售系统、基金销售支付结算系统、基金注册登记系统、基金会计系统等无法正常运行。

9、根据《基金合同》约定的基金份额折算方式及相关业务规则，须暂停接受申购申请的。

10、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之一（第4、7项除外）且基金管理人决定暂停接受申购时，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。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资者。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。

（十一）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者的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作或基金管理人不能支付赎回款项。

2、因不可抗力导致基金管理人无法接受投资者的赎回申请。

3、发生《基金合同》规定的暂停基金资产估值情况时。

4、证券交易场所交易时间非正常停市。

5、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

6、本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受赎回可能会影响或损害基金份额持有人利益时。

7、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，可暂停接受投资者的赎回申请。

8、基金管理人、基金托管人、登记结算机构、销售机构、支付结算机构等因异常情况导致基金销售系统、基金销售支付结算系统、基金注册登记系统、基金会计系统等无法正常运行。

9、根据《基金合同》约定的基金份额折算方式及相关业务规则，须暂停接受赎回申请的。

10、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暂停接受基金份额持有人赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应报中国证监会备案。若出现上述第5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。

（十二）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基础份额净赎回申请（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（包括基础份额、A类份额、B类份额的份额数之和）的10%，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，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者的全部赎回申请时，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者的赎回申请有困难或认为因支付投资者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（包括基础份额、A类份额、B类份额总和）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；对于未被赎回部分，投资者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。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。上海证券交易所、登记结算机构另有规定的，从其规定。

（3）暂停赎回：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20个工作日，并应当在指定媒介上进行公告。

（4）巨额赎回业务的场内处理，按照上海证券交易所及登记结算机构的有关规定办理

（5）巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，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3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

（十三）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，基金管理人应在规定期限内在指定媒介上刊登暂停公告。

2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

（十四）基金转换

为方便基金份额持有人，未来在各项技术条件和准备完备的情况下，基金管理人可以根据相关法律法规以及《基金合同》的规定决定开办本基金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《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。

（十五）基金的转托管

1、基金份额的登记

（1）本基金的基金份额采用分系统登记的原则。场外认购、申购或跨系统转托管至场外的基础份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；A类份额、B类份额、跨系统转托管至场内的基础份额以及场内认购、申购的基础份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人上海证券账户下。

（2）登记在证券登记结算系统中的基础份额可以申请场内赎回；登记在注册登记系统中的基础份额可申请场外赎回。

（3）登记在证券登记结算系统中的A类份额、B类份额只能在上海证券交易所上市交易，不能直接申请场内申购与赎回。

2、系统内转托管

（1）基金份额持有人可将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间进行系统内转托管或在证券登记结算系统内不同会员单位之间进行转指定。

（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基础份额赎回业务的销售机构（网点）时，须办理已持有基础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基础份额、A类份额、B类份额上市交易或基础份额场内赎回业务的会员单位时，须办理已持有基金份额转指定。

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基础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）基础份额跨系统转托管的具体业务按照上海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办理。

（3）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。

（十六）定期定额投资计划

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资者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。

（十七）其他

基金管理人可在相关法律法规允许、相应技术条件成熟的情况下，开通多币种（包括但不限于美元）的申购、赎回业务，不同币种的申购、赎回价格以受理申请当日的对应币种折算净值为基准计算。多币种的申购、赎回业务细则以基金管理人的相关公告为准。

十一、基金的非交易过户、冻结与质押

（一）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记结算机构受理继承、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结算机构认可、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者。

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结算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结算机构的规定办理，并按基金登记结算机构规定的标准收费。

（二）基金的冻结和解冻

基金登记结算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，以及登记结算机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

（三）基金份额的质押

在条件许可的情况下，基金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，并可收取一定的手续费。

十二、基金份额的配对转换

（一）份额配对转换业务及配对转换方式

份额配对转换是指本基金的基础份额与A类份额、B类份额之间的配对转换，包括分拆和合并两个方面。

1、分拆。指本基金存续期内，基金份额持有人申请将其持有的每2 份场内基础份额按1:1的比例转换为1 份A类份额与1份B类份额的行为。

2、合并。本基金存续期内，基金份额持有人将其持有的每1 份A类份额与每1 份B类份额申请按照1:1的比例转换成2份场内基础份额的行为。

场外基础份额不进行份额配对转换。在场外基础份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内份额配对转换规则进行操作。

（二）份额配对转换的业务办理时间

自场内基础份额、A类份额、B类份额上市交易后由基金管理人根据实际情况依法决定开始办理份额配对转换的具体日期，基金管理人应在开始办理份额配对转换前在指定媒介公告。

份额配对转换的业务办理日为上海证券交易所交易日（基金管理人公告暂停份额配对转换时除外），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。

若上海证券交易所交易时间更改或交际情况需要，基金管理人可对份额配对转换业务的办理时间进行调整并公告。

（三）份额配对转换的业务办理机构及业务办理费用

份额配对转换的业务办理机构及基金管理人届时发布的相关公告。

基金投资者应当在份额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份额配对转换。上海证券交易所、登记结算机构或基金管理人可根据情况变更或增减份额配对转换的业务办理机构，并予以公告。

本基金场内份额配对转换业务的办理机构可对该业务的办理酌情收取一定的费用，具体见《招募说明书》及相关业务公告。

（四）份额配对转换原则

1、份额配对转换以份额申请。

2、申请进行“分拆”的场内基础份额必须是偶数。

3、申请进行“合并”的A类份额与B类份额必须同时配对申请，且基金份额数必须为正整数且相等。

4、场外基础份额如需申请进行“分拆”，须跨系统转托管为场内基础份额后方可进行。

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、基金登记结算机构或上海证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前在指定媒介公告。

（五）份额配对转换的程序

份额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）暂停份额配对转换的情形

1、基金管理人根据本基金届时投资运作、交易及办理折算业务的实际情形可决定是否暂停接受配对转换。

2、基金管理人根据某一类或几类基金份额数量情况，认为有必要暂停分拆或合并的。

3、上海证券交易所、登记结算机构、份额配对转换业务办理机构因异常情况无法办理份额配对转换业务。

4、法律法规、上海证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述事项的，基金管理人应当在指定媒介刊登暂停份额配对转换业务的公告。在暂停份额配对转换的情况消除时，基金管理人应及时恢复份额配对转换业务的办理，并依照有关规定在指定媒介公告。

十三、基金份额的登记结算

（一）基金的份额登记结算业务

本基金的登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等。

（二）基金登记结算业务的办理机构

本基金的登记结算业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金份额持有人的合法权益。

本基金的登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。基金管理人也可以自行或委托其他机构担任登记结算机构。

本基金的基金份额采用分系统登记的原则。其中，场外基础份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内基础份额、A类份额与B类份额登记在证券登记结算系统持有人上海证券账户下。

（三）基金登记结算机构的权利

基金登记结算机构享有以下权利：

1、取得登记费；

2、建立和管理投资者基金账户；

3、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；

4、在法律法规允许的范围内，制定和调整登记业务相关规则，并依照有关规定于开始实施前在指定媒介上公告；

5、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。

（四）基金登记结算机构的义务

基金登记结算机构承担以下义务：

1、配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务；

2、严格按照法律法规及中国证监会规定和《基金合同》规定的条件办理本基金份额的登记业务；

3、妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自基金账户销户之日起不得少于20年；

4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形除外；

5、按《基金合同》和《招募说明书》及相关业务规则的规定为投资者办理非交易过户业务，并提供其他必要的服务；

6、接受基金管理人的监督；

7、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。

十四、基金的投资

（一）投资目标

紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差最小化。

（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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种，国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类品种，股指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，本基金可将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。

基金的投资组合比例为：

本基金投资于股票的比例不低于基金资产的90%；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%；在扣除股指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%。

若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人可对上述资产配置比例进行调整。

（三）投资策略

1、资产配置策略

本基金投资于股票的比例不低于基金资产的90%；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%；在扣除股指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%。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求及投资比例限制等因素，确定股票、债券等资产的具体配置比例。

本基金力争将年化跟踪误差控制在4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。

2. 权益类品种投资策略

（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。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取其他指数投资技术造当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于：

① 法律法规的限制；

② 标的指数成份股流动性严重不足；

③ 标的指数的成份股票长期停牌；

④ 标的指数成份股进行配股或增发；

⑤ 标的指数成份股派发现金股息；

⑥ 其他可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。

（2）股票组合的动态调整

在基金运作过程中，当发生以下情况时，基金管理人可对投资组合进行调整：

① 指数编制方法发生变更。基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成份股及权重的影响，适时进行投资组合调整；

② 指数成份股定期或临时调整。基金管理人将根据指数成份股调整方案，判断指数成份股调整对投资组合的影响，在此基础上确定组合调整策略；

③ 标的指数成份股出现股本变化、增发、配股、派发现金股息等情形。基金管理人将密切关注这些情形对指数的影响，并据此确定相应的投资组合调整策略；

④ 基金发生申购赎回等影响跟踪效果的情形。基金管理人将分析这些情形对跟踪效果的影响，据此对投资组合进行相应调整。

⑤ 法律法规限制、股票流动性不足、股票停牌等因素导致基金无法根据指数建立组合。基金管理人可根据市场情况，以跟踪误差最小化为原则对投资组合进行调整。

3.金融衍生品的投资策略

（1）股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

（2）权证为本基金辅助性投资工具。权证的投资原则为有利于基金资产增值、控制风险、实现保值和锁定收益。

4.其他

未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。

（四）业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：

95%×中证国有企业改革指数收益率＋5%×同期银行活期存款利率（税后）

若指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布及维护，或指数名称发生变更，或标的指数由其他指数替代，或标的指数因编制方法发生重大变更而不适合继续作为业绩比较基准的组成部分，或法律法规发生变化，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，和基金托管人协商一致并报中国证监会备案后，变更标的指数、调整业绩比较基准并及时公告，无须召开基金份额持有人大会审议。

（五）风险收益特征

从投资者持有的基金份额来看，本基金的基础份额为股票基金，主要采用完全复制策略跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数相似。长期而言，其风险收益水平高于混合基金、债券基金和货币市场基金。与基础份额相比，A类份额具有预期风险、收益较低的特征，其预期收益和预期风险低于基础份额；B类份额具有预期风险、收益较高的特征，其预期收益和预期风险高于基础份额。

（六）投资决策依据及决策程序

1.投资决策依据

(1) 法律、法规和《基金合同》的规定；

(2) 标的指数的编制方法及其调整公告等；

(3) 对证券市场发展趋势的研究与判断。

2.投资决策流程

(1) 基金经理制定资产配置计划，按照公司制度提交审议并实施。

(2) 基金经理依据指数成份股名单及权重，进行投资组合构建。

(3) 基金经理根据标的指数编制方案、标的指数成份股及其权重变化情况、基金申购赎回情况、指数成份股派息情况等，及时调整投资组合，以降低跟踪误差，实现对标的指数的紧密跟踪。

(4) 投资风险管理部门定期对投资组合的跟踪误差进行量化评估，提供基金经理参考。

(5) 基金经理参考有关研究报告及投资风险管理部的报告，及时进行投资组合调整。

（八）投资限制与禁止行为

1.投资限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于股票的比例不低于基金资产的90%；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%；

（2）在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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）基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证发行总量的 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）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，债券回购到期后不展期；

（13）本基金投资于股指期货，还应遵循如下投资组合限制：

①在任何交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约价值不超过基金资产净值的10%，卖出股指期货合约价值不超过基金持有的股票总市值的20%。

②在任何交易日日终，本基金持有的买入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）、权证、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。

④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%。

本基金管理人应当按照中国金融期货交易所的要求向其报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等。

（14）本基金基金总资产不得超过基金净资产的140%

（15）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。

基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的，应当根据风险管理的原则，并制定严格的授权管理制度和投资决策流程。基金管理人运用基金财产投资证券衍生品种的具体比例，应当符合中国证监会的有关规定。

因证券及期货市场波动、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，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，法律法规或监管部门另有规定的，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。上述期间，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》