（上接A18版）

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

本基金将通过场外和场内两种方式公开发售。

场外将通过基金销售机构（包括基金管理人的直销机构及其他销售机构，各销售机构的具体名单见基金份额发售公告及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告）公开发售。

场内将通过深圳证券交易所内具有基金销售业务资格并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会员单位发售。尚未取得基金销售业务资格，但属深圳证券交易所会员的其他机构，可在本基金份额上市后，通过深圳证券交易所交易系统参与本基金份额的上市交易。

通过场外认购的基金份额登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下；通过场内认购的基金份额登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下。

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、合格境外机构投资者和人民币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人。

四、募集规模

本基金的募集份额总额应不少于2亿份，募集金额总额应不少于2亿元人民币。

五、基金的初始面值、认购价格及计算公式、认购费用

1、本基金的基金份额初始面值为人民币1.00元，按初始面值发售。

2、认购费用

募集期内投资人可多次认购本基金，认购费用按每笔认购申请单独计算。

（1）本基金场外认购采用金额认购的方式，认购费率如下：

认购金额（M）	认购费率
M＜50万元	1.00%
50万元≤M＜100万元	0.50%
M≥100万元	每笔交易1,000.00元

（2）本基金场内认购采用份额认购的方式，认购费率如下：

认购份额（M）	认购费率
M＜50万份	1.00%
50万份≤M＜100万份	0.50%
M≥100万份	每笔交易1,000.00元

基金认购费用应在投资者认购基金份额时收取，基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

3、基金认购份额的计算

（1）场外认购份额的计算

本基金场外认购采用金额认购的方式。基金的认购金额包括认购费用和净认购金额。

1）场外认购费用适用比例费率时，计算公式为：

净认购金额＝认购金额/（1＋认购费率）

认购费用＝认购金额－净认购金额

认购份额＝净认购金额/基金份额初始面值

利息折算份额＝认购期间的利息/基金份额初始面值

认购份额总额＝认购份额＋利息折算份额

2）场外认购费用为固定金额时，计算公式为：

认购费用＝固定金额

净认购金额＝认购金额－认购费用

认购份额＝净认购金额/基金份额初始面值

利息折算份额＝认购期间的利息/基金份额初始面值

认购份额总额＝认购份额＋利息折算份额

认购费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留至小数点后两位。场外认购份额的计算结果按照四舍五入的方法保留至小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。场外认购利息折算的基金份额按截位法保留到小数点后两位，小数点第三位以后部分舍去归基金资产。

例：某投资人投资10,000.00元通过场外认购本基金，认购费率为1.00%，假定募集期间认购资金所得利息为2.50元，则根据公式计算出：

净认购金额＝10,000.00/（1＋1.00%）＝9,900.99元

认购费用＝10,000.00－9,900.99＝99.01元

认购份额＝9,900.99/1.00＝9,900.99份

利息折算份额＝2.50/1.00＝2.50份

认购份额总额＝9,900.99＋2.50＝9,903.49份

即投资人投资10,000.00元通过场外认购本基金，假定募集期间认购资金所得利息为2.50元，可得到9,903.49份基金场外份额。

（2）场内认购金额和利息折算份额的计算

基金场内认购采用份额认购的方式。本基金份额初始面值为人民币1.00元，挂牌价格为人民币1.00元/份。

1）场内认购费用适用比例费率时，计算公式为：

净认购金额＝挂牌价格×认购份额

认购费用＝挂牌价格×认购份额×认购费率

认购金额＝净认购金额+认购费用

利息折算份额＝认购期间的利息/挂牌价格

认购份额总额＝认购份额＋利息折算份额

2）场内认购费用为固定金额时，计算公式为：

净认购金额＝挂牌价格×认购份额

认购金额＝净认购金额＋认购费用

利息折算份额＝认购期间的利息/挂牌价格

认购份额总额＝认购份额＋利息折算份额

场内认购金额计算结果按照四舍五入方法，保留至小数点后两位。利息折算的份额采用截位法保留至整数位，余额计入基金资产。

例：某投资人场内认购本基金10,000份，认购费率为1.00%，假定募集期间认购资金所得利息为2.50元，则根据公式计算出：

净认购金额＝1.00×10,000＝10,000.00元

认购费用＝1,00×10,000×1.00%＝100.00元

认购金额＝10,000.00＋100.00＝10,100.00元

利息折算份额＝2.50/1.00＝2份（截位法保留至整数位）

认购份额总额＝10,000＋2＝10,002份

即投资人场内认购本基金10,000份，需缴纳认购金额10,100.00元，假定募集期间认购资金所得利息为2.50元，利息折算的份额截位保留至整数位为2份，其余0.50份对应金额计入基金资产，最后该投资人实际的认购份额为10,002份。

六、认购安排

1、认购时间

投资人认购本基金份额的具体业务办理时间由基金管理人和基金销售机构确定，请参见本基金的基金份额发售公告或基金销售机构的相关公告。

2、投资人认购本基金份额应提交的文件和办理的手续

投资人认购本基金所应提交的文件和具体办理手续详见本基金的基金份额发售公告或基金销售机构的相关业务办理规则。

3、认购方式和确认

（1）本基金场外认购采用金额认购的方式，场内认购采用份额认购的方式。

（2）投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。若资金未全额到账则认购无效，基金管理人将认购无效的款项退回。

（3）投资人在募集期内可以多次认购基金份额，认购费按每笔认购申请单独计算。认购一经受理不得撤销。

4、认购的限制

（1）场外认购限制

投资人通过场外认购本基金时，投资人单笔最低认购金额为100.00元（含认购费）。各销售机构对本基金最低认购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

（2）场内认购限制

投资人通过场内认购本基金时，投资人单笔最低认购份额为1,000份，超过1,000份的必须是1,000份的整数倍。

（3）本基金认购期间对单个投资人的累计认购规模不设限制。

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。认购的确认以注册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，由于投资人的过错产生的任何损失由投资人自行承担。

七、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，其中利息转份额以注册登记机构的记录为准。

八、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。

第七部分　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日内返还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息；

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，本基金将按照基金合同的约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会审议。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

第八部分　基金份额的上市交易

基金合同生效后，在本基金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，本基金基金份额在深圳证券交易所上市交易。

一、上市交易的地点

本基金上市交易的地点为深圳证券交易所。

二、上市交易的时间

在确定本基金基金份额上市交易的时间后，基金管理人应依据有关规定在指定媒介上刊登基金份额上市交易公告书。

基金份额上市交易后，登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统中的场外基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至场内证券登记系统后，方可上市交易。

三、上市交易的规则

本基金的上市交易需遵循《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所上市开放式基金登记结算业务指引》等深圳证券交易所相关业务规则、通知、指引、指南等有关规定。

四、上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

五、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市等按照《基金法》和相关法律法规以及深圳证券交易所的相关业务规则、通知、指引、指南等有关规定执行。

六、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，本基金基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无需召开基金份额持有人大会审议。

七、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，本基金可以增加相应功能，无需召开基金份额持有人大会审议。

在不违反法律法规的规定及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，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，而无需召开基金份额持有人大会审议。

第九部分　基金份额的申购与赎回

一、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。投资人可以使用开放式基金账户，通过基金管理人的直销机构及其他场外销售机构办理场外份额的申购和赎回业务。基金投资人也可使用深圳证券账户，通过深圳证券交易所内具有基金销售业务资格并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会员单位利用深圳证券交易所交易系统办理场内份额的申购和赎回业务。具体的销售机构将由基金管理人在相关公告中列明。基金管理人可根据情况调整销售机构，并予以公告。若基金管理人或其指定的销售机构开通电话、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，具体参见各销售机构的相关公告。投资人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。

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。

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3个月开始办理申购，具体业务办理时间在相关公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，具体业务办理时间在相关公告中规定。

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、赎回或转换申请且注册登记机构确认接受的，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。

三、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、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、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场内申购、赎回业务时，需遵守深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则。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。

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项时，申购成立；注册登记机构确认基金份额时，申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立，申购款项将退回投资人账户，基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息损失。

基金份额持有人递交赎回申请时，赎回成立；注册登记机构确认赎回时，赎回生效。基金份额持有人赎回生效后，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，本基金注册登记机构在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，投资人应在T+2日后（包括该日）及时到销售机构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。

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、赎回的确认以注册登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，依法对上述申购和赎回申请的确认时间进行调整，并必须在调整实施日前按照《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。

五、申购和赎回的数量限制

1、投资人场外申购本基金，单笔申购最低金额为100.00元（含申购费）。各销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。投资人当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。

2、基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回。基金份额持有人办理基金份额场外赎回时，单笔赎回申请的最低份额为100.00份，若某基金份额持有人赎回时在销售机构保留的基金份额不足100.00份，则该次赎回时必须一起赎回。

3、对于场内申购、赎回及持有场内份额的数量限制，深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则有规定的，从其最新规定办理。

4、本基金不对投资人每个基金交易账户的最低基金份额余额进行限制，但各销售机构对交易账户最低份额余额有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

5、本基金不对单个投资人累计持有的基金份额上限进行限制。

6、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实施前依照《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、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、申购费用

（1）投资人场内申购，无申购费用。

（2）投资人场外申购时，申购费率如下表所示：

申购金额（M）	申购费率
M＜50万元	1.20%
50万元≤M＜100万元	0.80%
100万元≤M＜500万元	0.50%
M≥500万元	每笔交易1,000.00元

申购费用由基金份额申购人承担，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。

2、赎回费用

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%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。

本基金的场外赎回费率不高于0.50%，随着基金份额持有期限的增加而递减；本基金的场内赎回费率为固定赎回费率0.50%，不按份额持有时间分段设置赎回费率：

	申请份额持有时间（N）	赎回费率
场外赎回费	N＜365日	0.50%
	365日≤N＜730日	0.25%
	N≥730日	0.00%
场内赎回费	本基金场内赎回费率为固定值0.50%，不按份额持有时间分段设置赎回费率。	

在确定场外赎回适用的赎回费率时，通过场外认购或场外申购获得的基金份额，其持有期限以份额实际持有期限为准，通过场内认购或场内申购并转托管至场外赎回的基金份额，其持有期限自份额转托管至场外之日起开始计算。

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、办理场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。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，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无需召开基金份额持有人大会审议。

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况下根据市场情况制定基金持续营销计划，定期和不定期地开展基金持续营销活动。在基金持续营销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对投资人适当调低基金申购费率。

七、申购份额与赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算方式

本基金场外申购和场内申购均采用金额申购的方式。基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。

（1）场外申购份额的计算

1）本基金基金份额的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日基金份额净值

2）本基金基金份额的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日基金份额净值

（2）场内申购份额的计算

本基金场内申购份额的计算方法如下：

申购份额＝申购金额/T日基金份额净值

场外申购份额的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。场内申购份额的计算结果先按四舍五入的原则保留到小数点后两位，再按截位法保留到整数位，小数部分对应的剩余金额返还至投资人资金账户。

例：T日，某投资人投资10,000.00元通过场外申购本基金，申购费率为1.20%，假设T日本基金的基金份额净值为1.0400元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额＝10,000.00/（1＋1.20%）＝9,881.42元

申购费用＝10,000.00－9,881.42＝118.58元

申购份额＝9,881.42/1.0400＝9,501.37份

即投资人投资10,000.00元通过场外申购本基金，对应申购费率为1.20%，假设T日基金份额净值为1.0400元，则可得到9,501.37份基金份额。

例：T日，某投资人投资10,000.00元通过场内申购本基金，假设申购当日本基金的基金份额净值为1.0400元，则其可得到的申购份额为：

申购份额＝10,000.00/1.0400＝9,615.38份

投资人是场内申购，故所得份额为9,615份，整数位后小数部分的申购份额（0.38份）对应的资金返还至投资人账户。具体计算公式为：

实际净申购金额＝9,615×1.0400＝9,999.60元

退款金额＝10,000.00－9,999.60＝0.40元

即投资人投资10,000.00元通过场内申购本基金，假设T日基金份额净值为1.0400元，则可得到9,615份基金份额，退还金额为0.40元。

2、赎回金额的计算方式

本基金场外赎回和场内赎回均采用份额赎回的方式，赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。具体计算公式为：

赎回金额＝赎回份额×T日基金份额净值

赎回费用＝赎回金额×赎回费率

净赎回金额＝赎回金额－赎回费用

赎回金额的计算结果以四舍五入的原则保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资人在场外赎回10,000份基金份额，该份额的持有时间为60日，对应的赎回费率为0.50%，假设赎回当日基金份额净值是1.2000元，则其可获得的赎回金额为：

赎回金额＝10,000×1.2000＝12,000.00元

赎回费用＝12,000.00×0.50%＝60.00元

净赎回金额＝12,000.00－60.00＝11,940.00元

即投资人在场外赎回10,000份基金份额，该份额的持有时间为60日，对应的赎回费率为0.50%，假设赎回当日基金份额净值是1.2000元，则其可获得的赎回金额为11,940.00元。

例：某投资人在场内赎回10,000份基金份额，该份额的持有时间为60日，对应的赎回费率为0.50%，假设赎回当日基金份额净值是1.2000元，则其可获得的赎回金额为：

赎回金额＝10,000×1.2000＝12,000.00元

赎回费用＝12,000.00×0.50%＝60.00元

净赎回金额＝12,000.00－60.00＝11,940.00元

即投资人在场内赎回10,000份基金份额，该份额的持有时间为60日，对应的赎回费率为0.50%，假设赎回当日基金份额净值是1.2000元，则其可获得的赎回金额为11,940.00元。

3、本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，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

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无法正常运作。

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受投资人的申购申请。

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、接受某笔或某些申购申请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，或出现其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、指数编制单位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。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、6、7、8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。

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基金份额持有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受基金份额持有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、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时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

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暂停接受赎回申请或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。当出现暂停赎回或延缓支付赎回款项时，场内赎回申请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有关业务规则办理。在暂停赎回或延缓支付赎回款项的情况消除时，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基金份额净赎回申请（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基金份额持有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基金份额持有人的赎回申请有困难或认为因支付基金份额持有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，基金份额持有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。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（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。

3、巨额赎回的场内处理方式

巨额赎回的场内处理，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有关业务规则办理。

4、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者基金管理人网站在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，基金管理人当日应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个开放日的基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过1日，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。

十二、基金转换

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。

十三、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、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注册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注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

十四、基金的转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，包括系统内转托管和跨系统转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

1、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基金份额在登记结算系统内不同销售机构之间进行转托管的行为或在证券登记系统内不同会员单位之间进行转托管的行为。

（2）基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变更办理基金份额场外赎回的销售机构时，需办理已持有基金份额的系统内转托管。

（3）基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变更办理基金份额场内赎回或交易的会员单位时，需办理已持有基金份额的系统内转托管。

2、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金份额在登记结算系统和证券登记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及深圳证券交易所的相关规定办理。

十五、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申购金额，每期申购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。

十六、基金份额的冻结和解冻

基金注册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，以及注册登记机构认可、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。

十七、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注册登记机构办理基金份额的过户注册登记。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。

十八、如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

第十部分　基金的投资

一、投资目标

本基金紧密跟踪标的指数，追求基金净值收益率与业绩比较基准之间的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

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）、债券（包括国债、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）、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、资产支持证券、银行存款等固定收益类品种、权证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：本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于85%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；本基金所持有的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%。

如法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许，本基金管理人可在履行适当程序后对上述资产配置比例进行调整。

三、投资策略

1、股票投资策略

本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。

在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求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。

2、固定收益类投资工具投资策略

本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券等固定收益类金融工具，投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。

3、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合考虑信用等级、债券期限结构、分散化投资、行业分布等因素，坚持价值投资理念，把握市场交易机会。在严格遵守法律法规的基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

4、权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并积极利用正股和权证之间的不同组合来套取无风险收益。本基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

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）本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于85%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%且不低于股票资产净值的90%；

（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）本基金投资于权证的投资限制如下：

1）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%；

2）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%；

3）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%；

（4）本基金投资于资产支持证券的投资限制如下：

1）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%；

2）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%；

3）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%；

4）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%；

5）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；

（5）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；

（6）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%，本基金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；

（7）本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金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%；

（8）本基金参与转融通证券出借交易的，每个交易日日终，本基金参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的50%，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；

（9）本基金资产总值不超过基金资产净值的140%；

（10）本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应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；

（11）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、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，基金管理人应当在相关证券可交易的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