

通过上海证券交易所办理开放式基金相关业务操作指引

第一章 总则

一、为进一步明确通过上海证券交易所（以下简称“上证所”）办理开放式基金认购、申购、赎回、转托管等业务流程和具体要求，依据上证所《开放式基金认购、申购、赎回业务办理规则（试行）》、中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算公司”）《开放式基金通过上海证券交易所认购、申购与赎回登记结算业务实施细则》，上证所和中国结算公司制定本指引。

二、通过上证所办理开放式基金认购、申购与赎回（以下简称“上证所场内认购、申购与赎回”），是在现有的通过基金管理人及其代销机构办理认购、申购与赎回（以下简称“场外认购、申购与赎回”）之外，为投资者新推出的开放式基金业务办理渠道。

三、由中国证监会核准的具有开放式基金代销资格，并经上证所及中国结算公司认可的上证所会员（以下简称“有资格的上证所会员”），可通过上证所开放式基金销售系统（以下简称“上证所场内系统”）从事自营或代理投资者办理开放式基金的上证所场内认购、申购与赎回等业务。

四、投资者通过上证所场内系统认购、申购与赎回基金份额的，应根据《上海证券交易所全面指定交易制度试行办法》的规定，指定有资格的上证所会员代为办理。

五、场内系统与上证所以外基金管理人及其代销机构的开放式基金柜台销售系统（以下简称“场外系统”）相互独立、并行运作。投资者可选择通过场内系统或场外系统申购、赎回基金份额。

第二章 基金简称、代码和账户管理

一、基金简称和代码

上证所根据基金管理人申请，为通过上证所场内系统发售、申购、赎回的开放式基金提供简称和代码。基金管理人及其代销机构、基金托管人应使用与本所相同的基金简称和代码。

基金简称不超过 4 个汉字或 8 个字符，应能同时标识基金管理人和基金产品。

基金代码由 6 位阿拉伯数字构成，其结构为 5##***，其中，## 标识申报类型，***标识基金产品序号。具体地，519***标识基金挂牌代码和申购赎回代码；521***标识认购代码；522***标识跨市场转托管代码；523***标识设置基金分红方式代码。

二、账户管理

（一）上证所场内认购、申购与赎回的账户管理

投资者办理上证所场内认购、申购与赎回，应使用上海人民币普通股票账户或证券投资基金账户（以下简称“上海证券账户”）。

已有上海证券账户的，可直接办理上证所场内认购、申购与赎回。

尚无上海证券账户的，可通过中国结算公司开户代理机构开立账户。

（二）场外认购、申购与赎回的账户管理

投资者办理场外认购、申购、赎回，应使用中国结算公司上海开放式基金账户。

已有上海证券账户的，可通过场外基金管理人或代销机构将其注册成为上海开放式基金账户。

尚无上海证券账户的，可通过场外基金管理人或代销机构直接申请账户注册，中国结算公司将其配发上海证券投资基金账户，同时将该账户注册成为上海开放式基金账户。

成功注册了上海开放式基金账户后，投资者可在原办理账户注册或账户注册确认的基金管理人或代销机构处直接办理场外认购、申购与赎回；如拟通过其他的代销机构办理场外认购、申购与赎回，则须先持上海开放式基金账户通过其办理账户注册确认。

第三章 基金份额的认购

一、 基金份额的认购时间与认购场所

基金募集期内，上证所接收认购申报的时间为每个交易日的撮合交易时间（9:30至11:30，13:00至15:00）和大宗交易时间（15:00至15:30）。

二、 认购价格及认购费用

基金募集期内，上证所在每个交易日的交易时间，在行情发布系统中的“最新价”栏目揭示每份基金份额的面值。

基金管理人可按认购金额分段设置认购费率，认购费率由基金管

理人在《基金招募说明书》中约定。

中国结算公司开放式基金登记结算系统（TA 系统）依据管理人给定的认购费率，按内扣法或外扣法计算投资者认购所得基金份额。具体份额计算公式参见基金管理人公告的基金募集文件。

三、 认购申报要素

认购申报的证券代码为 521***，采用“金额认购”方式，投资者以认购金额填报数量申请，买卖方向只能为买。

最低认购金额由基金管理公司确定并公告。在最低认购金额基础上，累加认购申报金额为 100 元或其整数倍，但单笔申报最高不得超过 99,999,900 元。

在同一认购日可进行多次认购申报，申报指令可以更改或撤销，但认购申报已被受理除外。

四、 认购资金利息处理

上证所场内认购资金在基金募集期形成的利息折算成基金份额，归投资者所有，利息折算的基金份额数额以中国结算公司的记录为准。认购利息折算的基金份额精确到整数位，小数部分舍去归基金资产。

五、 认购处理流程

（一）基金募集期内，上证所场内认购处理流程

1、T 日，投资者通过有资格的上证所会员申报认购开放式基金。当日收市后，上证所将该日来自不同席位的认购申报数据发送给中国结算公司 TA 系统，同时将当日认购明细申请回执数据发送给相应的

上证所有资格会员的席位。

2、T 日，中国结算公司对当日上证所场内及场外认购数据一并进行处理，生成认购待确认数据传送基金管理人。

对于该日来自不同席位的认购申报数据，中国结算公司根据当日交易席位与结算参与人的对应关系，确定资金清算路径，以及各席位分别适用的认购代理费率。

3、T+1 日，中国结算公司根据基金管理人传送的认购确认数据，生成认购交易回报数据，并发送给上证所，上证所将认购交易回报数据分别发送给相应的有资格的上证所会员的席位。

该日，中国结算公司根据 T 日确定的资金清算路径，对上证所场内认购数据进行资金清算，按席位生成资金清算结果明细，发送相关结算参与人，通知其及时划拨应付款项。

4、T+2 日，各结算参与人通过其在中国结算公司开立的开放式基金结算备付金账户完成上证所场内认购的资金交收，全部认购款上缴中国结算公司开放式基金募集专户。

认购资金交收遵循“先满足申购赎回资金交收，后满足认购资金交收”的原则。T+2 日日终，若结算参与人资金交收违约，则中国结算公司与交收资金不足的结算参与人联系，通知其于 T+3 日 11:00 之前提供无效认购明细表。

5、T+3 日，中国结算公司按照结算参与人提供的无效认购明细表对上证所场内、场外认购数据统一进行无效处理；结算参与人不按时提供无效认购明细表的，中国结算公司按上证所场内、场外认购数

据申报时间的顺序，由后向前统一进行无效处理。

基金募集期内的每一认购日均按上述流程滚动处理。

(二) 基金募集结束时，按以下流程处理：

1、N日，基金募集最后一个认购日。N日收市后，上证所对基金认购代码作次日停牌处理。

2、N+1日，停止基金认购申报，当日收市后，上证所对基金认购代码作次日摘牌处理。

3、N+2日（N+2日出现认购资金不足的，则顺延至N+3日），中国结算公司将基金募集期内全部有效的上证所场内、场外的认购数据发送基金管理人做最终确认。

4、N+3日（N+2日出现认购资金不足的，则顺延至N+4日），中国结算公司根据基金管理人的最终认购确认数据完成基金募集结束处理，并将上证所场内认购基金份额确认结果发送上证所。上证所将场内认购基金份额确认结果发送相应的有资格的上证所会员的席位。

5、N+4日（N+2日出现认购资金不足的，则顺延至N+5日），中国结算公司将基金募集资金由基金认购专户划出，由基金管理人或基金托管人将其划入基金募集验资户。

同日，中国结算公司将不足一份基金份额部分的认购资金零头返还给结算参与人，再由结算参与人将其返还给投资者。

(三) 基金管理人须于基金合同生效后三个工作日内，到中国结算公司办理上证所场内、场外基金份额的募集登记手续。中国结算公司自受理登记申请之日起两个工作日内完成基金份额登记，出具《基

金份额登记确认书》交基金管理人。

(四)投资者通过上证所场内系统认购所得的基金份额由中国结算公司 TA 系统登记在投资者上海证券账户内,托管在该投资者上海证券账户指定交易所属的上证所会员处。

(五)基金募集期内,所有投资者的认购资金将被冻结。中国结算公司将所冻结资金利息在中国人民银行规定的结息日的下一个工作日划付到该基金结算备付金账户;如基金募集期跨越季度结息日,则相应利息分两次划付。

第四章 基金份额的申购与赎回

一、 基金份额的申购、赎回时间与场所

上证所在每个交易日的撮合交易时间(9:30至11:30,13:00至15:00)内,接受基金份额申购、赎回的申报。

上证所在申购赎回时间,在行情发布系统中的“最新价”栏目揭示前一交易日每百份基金份额净值。

基金管理人可以依据有关法律、法规、行政规章的规定,提前1个工作日,以书面形式向上证所申请暂停基金份额的申购或赎回。暂停期结束后,可以向本所申请重新开放基金份额申购或赎回。

二、 申购、赎回申报要素

申购、赎回的证券代码为519***,采用“金额申购”、“份额赎回”原则,即以申购金额填报数量申请,以赎回份额填报数量申请。

“申购”对应“买入”,“赎回”对应“卖出”。申购、赎回的成交价

格按当日基金份额净值确定。由于申报价格栏不能空白，故约定始终都填写为“1元”。

最低申购金额及赎回份额由基金管理人确定并公告。在最低申购金额的基础上，累加申购金额为100元或其整数倍，但最高不能超过99,999,900元；单笔赎回的基金份额为整数份，但最高不能超过99,999,999份。

同一交易日可进行多次申购或赎回申报，申报指令可以更改或撤销，但申报已被受理除外。

上证所对申购、赎回申报申请直接转发给中国结算公司，并由中国结算公司负责校验。投资者申购（赎回）后所得的基金份额（赎回金额），由中国结算公司予以确认。

三、 申购、赎回处理流程

（一）上证所场内申购、赎回申报处理流程

1、T日，投资者通过有资格的上证所会员营业部提交开放式基金申购、赎回申报。T日收市后，上证所将当日来自不同席位的申购、赎回申报数据发送给中国结算公司，同时将相关申报明细回执数据发送给有资格的上证所会员席位。

2、T日，结算参与者应自行计算当日上海、深圳证券交易所场内及场外净申购金额：

$$T \text{ 日净申购金额} = (T \text{ 日上海、深圳交易所场内及场外申购金额} - \text{申购代理费}) - (T-N+2 \text{ 日上海、深圳交易所场内及场外赎回金额} - \text{赎回手续费} + \text{赎回代理费})$$
，其中N为基金管理人规定的赎回交收

周期，且 $N \geq 2$ 。

若净申购金额超过中国结算公司规定额度(目前净申购额度暂定为 5000 万)，则应于 T+1 日 11:30 前主动向中国结算公司提供合格结算担保品，担保品原则上为结算备付金。

未能按时足额提供结算担保品的净申购金额部分，由中国结算公司按该结算参与者申购申请的提交时间顺序，由后向前，对无结算担保品的申购申请做无效拉单处理。

3、T 日日终，中国结算公司依据基金管理人传送的当日单位份额净值，对当日上证场内、场外申购、赎回数据一并进行处理，生成申购、赎回交易待确认数据传送基金管理人。

4、T+1 日，中国结算公司 TA 系统根据基金管理人传送的申购、赎回确认数据，并经申购拉单处理后，完成有效申购、赎回基金份额过户登记，记增、记减投资者上海证券账户基金份额，并将申购(赎回)确认数据发送给上证所，上证所将该数据分别发送给相应的有资格的上证所会员的席位。

5、T+2 日起，投资者可在提交申报的上证所会员营业部处查询到申购、赎回处理结果和申购所得基金份额。

(二) 上证所场内申购、赎回资金结算流程

1、C 日(清算日)，中国结算公司对结算参与者 C-1 日上海、深圳交易所场内及场外申购，以及 C-N+1 日(N 为基金管理人规定的赎回交收周期，且 $N \geq 2$) 赎回合并清算，轧差出资金净额，并将相关明细到席位的资金清算结果通知结算参与者。

2、C+1日（交收日），结算参与人根据中国结算公司资金清算结果，通过其在中国结算公司开立的开放式基金结算备付金账户完成申购、赎回的相关资金交收。对于上证所场内申购业务，结算参与人向中国结算公司上缴扣除不足一份基金份额部分的申购资金零头之后的实际申购资金。

第五章 基金份额的转托管

投资者可将基金份额在上证所场内不同会员营业部之间进行转指定，也可在上证所场内系统和场外系统之间进行跨市场转托管。

在开放式基金开放申购、赎回后，投资者可以申请办理，但存在质押、冻结或其他特殊情形可能影响份额持有人权益的基金份额，不能申请转托管。

一、 基金份额在上证所场内不同会员营业部之间进行转指定处理流程

在上证所系统内进行基金份额转托管的，按照《上海证券交易所全面指定交易制度试行办法》中有关规定办理。

二、 跨市场转托管申报要素

跨市场转托管的证券代码为522***，“转出”对应“卖出”，“转入”对应“买入”。

对于转出，价格栏填写转入方的销售人代码，范围1-999元。

转托管数量的下限为1份，最高不能超过99,999,999份。

三、 基金份额在上证所场内系统和场外系统之间进行转托

管处理流程

(一) 账户规定

该类转托管只限于在场内上海证券账户和以其为基础在场外系统注册的上海开放式基金账户之间进行。

(二) 将上证所场内基金份额转托管至场外系统业务处理流程:

1、投资者申请将基金份额转出上证所场内系统的，应确保按照中国结算公司《开放式基金登记结算业务指南》相关规定，已在场外基金管理人或其代销机构处成功办理开放式基金账户注册或开放式基金账户注册确认（具体可参见第二章第二节账户相关内容），并获知该基金管理人或代销机构代码（该代码为六位阿拉伯数字，首位数字为6）。

2、T日，投资者持有效身份证明文件和上海证券账户卡到转出方上证所会员营业部提交转托管申请。转出方上证所会员营业部应按照上证所相关数据接口规范要求申报转托管，必须注明转入方基金管理人或其代销机构代码、证券账户号码、基金代码和转托管数量。上证所将转托管申请数据发送给中国结算公司TA系统。

3、T日日终，中国结算公司TA系统处理转托管申报。对于合格转托管申报数据，记减投资者上海证券账户基金份额，同时相应记增开放式基金账户基金份额；对于不合格转托管申报数据，注明失败原因并反馈转出方上证所会员营业部。

4、T+1日，中国结算公司将成功及失败转托管处理结果反馈给上证所，上证所将其发送给有资格的转出方上证所会员席位。

同日，中国结算公司将成功转托管处理结果发送场外转入方基金管理人或其代销机构。

5、T+2 日起，投资者可在场外转入方基金管理人或其代销机构处查询到该转托管转入基金份额。

(三)将场外系统基金份额转托管至上交所场内系统业务处理流程：

1、投资者申请将基金份额转入场内系统的，应持有效身份证件到拟转入的有资格的上交所会员营业部办理指定交易，已办理指定交易的除外。

2、T 日，投资者在场外转出方基金管理人或其代销机构处提出基金份额转托管申请。场外转出方基金管理人或其代销机构应按照中国结算公司相关数据接口规范要求申报转托管，必须注明转入方（上交所）代码、开放式基金账户号码、基金代码和转托管数量，其中转托管数量应该为整数份。

3、T 日日终，中国结算公司 TA 系统处理转托管申报。对于合格转托管申报数据，记减投资者上海开放式基金账户基金份额，同时相应记增上海证券账户基金份额；对于不合格转托管申报数据，注明失败原因反馈转出方基金管理人或其代销机构。

4、T+1 日，中国结算公司将成功及失败转托管处理结果反馈给场外转出方基金管理人或其代销机构。

同日，中国结算公司将成功转托管处理结果发送上交所，上交所将其发送给有资格的转入方上交所会员席位。

5、T+2 日起，投资者可在场内指定交易所属有资格的上证所会员处查询到该转托管转入基金份额。

(四)由于转托管导致上海证券账户或开放式基金账户内的基金份额低于基金管理人规定的单个账户最低持有限额时，中国结算公司TA 系统将对账户内剩余基金份额做强制赎回处理。

第六章 基金权益分派

一、 基金权益分派方式申报

设置基金分红方式的申报证券代码为 523***，买卖方向只能为“买”，不能为“卖”；“价格”填写基金分红方式代码，其中 100 元为红利转投，101 元为现金分红；申报数量为 1。

二、 基金权益分派办理流程

(一)基金管理人应于权益分派公告前两个工作日，预先向上证所和中国结算公司提交权益分派申请。

(二)权益登记日(R 日)之前(不含 R 日)，投资者可进行基金权益分派方式申报。多次申报的，以最后一次申报为准。

(三)基金管理人应于 R 日 19:00 前将最终确定的分红比例方案通知中国结算公司。如在规定时点后修改分红比例方案的，应重新确定权益登记日。

(四)R+1 日，中国结算公司将红利再投资基金份额登记在投资者上海证券账户内，并将红利再投资份额到账回报发送上证所。上证所将该回报分别发送给相应的有资格的上证所会员席位。

同日，中国结算公司计算投资者应得现金红利，并将基金权益分派划款金额通知基金管理人。

(五) R+2 日 12:00 前，基金管理人或基金托管人将现金红利划入中国结算公司指定账户。现金红利款足额到账后，中国结算公司于次一工作日将现金红利划入结算参与人结算备付金账户，由结算参与人将其及时派发给投资者。

如现金红利款未能足额到账，则中国结算公司推迟现金红利派发，直到现金红利款足额到账后的次一工作日派发。