（上接A25版）

电话：021-23238888
传真：021-23238800
经办注册会计师：单峰、陈熹

六、基金的募集

（一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集。本基金募集申请已经中国证监会2014年6月3日证监许可[2014]543号文准予募集注册。

（二）基金类型和存续期间

1、基金的类别：股票型证券投资基金。

2、基金的运作方式：交易型开放式。

3、基金存续期间：不定期。

（三）募集方式

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式认购本基金。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构用上海证券交易所网上系统以现金进行的认购；网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行的认购；网下股票认购是指投资者通过基金管理人和/或其指定的发售代理机构以股票进行的认购。

基金管理人可以根据具体情况调整基金的发售方式，并在基金份额发售公告中列明。

基金管理人可以根据情况调整发售代理机构，并另行公告。

基金投资人在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。

（四）募集期限

本基金的募集期限不超过3个月，自基金份额开始发售之日起计算。

本基金自2014年6月23日至2014年7月11日进行发售。

网上现金认购的日期为2014年7月9日至2014年7月11日，如证券交易所对网上现金认购时间做出调整，基金管理人将做出相应调整并及时公告；

网下现金认购的日期为2014年6月23日至2014年7月11日，

网下股票认购的日期为2014年6月23日至2014年7月11日。

如果在此期间未达到本招募说明书第七条第（一）款规定的基金备案条件，基金可在募集期限内继续销售，直到达到基金备案条件。基金管理人也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

（五）募集对象

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、机构投资者和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。

（六）募集场所

投资者应当在基金管理人及发售代理机构办理基金认购业务的营业场所或按基金管理人、发售代理机构提供的其他方式办理基金的认购。基金管理人、发售代理机构办理基金认购业务的地区、网点的具体情况和联系方法，请参见本基金基金份额发售公告以及当地销售机构的公告。

（七）基金份额初始面值、认购价格

本基金基金份额初始面值为1.00元，认购价格为1.00元。

（八）认购费用

本基金的认购采用份额认购的原则。

认购费用由投资者承担，具体的认购费率如下：

认购份额	认购费率/佣金比率
50万份以下	0.08%
50万份（含）—100万份	0.05%
100万份以上（含）	每笔500元

基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。认购费用用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用，不列入基金资产。

（九）认购开户

投资者认购本基金时需具有上海证券账户，上海证券账户是指上海证券交易所A股账户或基金账户。

1、如投资者需新开立证券账户，则应注意：

（1）上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资者需要使用标的指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所A股账户；如投资者需要使用标的指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所A股账户。

（2）开户当日无法办理指定交易，建议投资者在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。

2、如投资者已开立证券账户，则应注意：

（1）如投资者未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司，需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

（2）当日办理指定交易或转指定交易的投资者当日无法进行认购，建议投资者在进行认购前至少1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

（十）网上现金认购

1、认购时间：网上现金认购的日期为2014年7月9日至2014年7月11日9:30~11:30和13:00~15:00。

2、认购限额：网上现金认购以基金份额申请。投资者应以上海证券账户认购，单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍，最高不得超过99,999,000份。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

3、通过发售代理机构进行网上现金认购，认购以基金份额申请，认购佣金和认购金额的计算公式为：

认购佣金＝认购份额×认购份额×佣金比率

认购金额＝认购份额×认购份额×（1＋佣金比率）

认购佣金由发售代理机构收取，投资者需以现金方式缴纳认购佣金。

4、认购手续：投资者在认购时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。

5、清算交收：T日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金，登记结算机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人于网上现金认购结束后的第4个工作日将实际到位的认购资金划往预先开设的基金募集专户。

6、认购确认：在基金合同生效后，投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

（十一）网下现金认购

1、认购时间：网下现金认购的日期为2014年6月23日至2014年7月11日，具体业务办理时间由基金管理人及其指定的发售代理机构确定。

2、认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资者通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为1,000份或其整数倍，投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在10万份以上（含10万份）。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

3、通过基金管理人进行网下现金认购的投资者，认购申请提交后不得撤销，认购以基金份额申请，认购费用和认购金额的计算公式为：

认购费用＝认购份额×认购费率

认购金额＝认购份额×（1＋认购费率）

利息折算的份额＝利息/认购价格

通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

4、认购手续：投资者在认购时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。

5、清算交收：T日通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人于T＋2日内进行有效认购款项的清算交收。募集期结束后，基金管理人将于第4个工作日将汇总的认购款项及其利息划往基金管理人预先开设的基金募集专户。

T日通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金。在网下现金认购的最后一个工作日，各发售代理机构将每一个投资者账户提交的网下现金认购申请汇总后，通过上海证券交易所上网定价发行系统代该投资者提交网上现金认购申请。之后，登记结算机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人将实际到位的认购资金划往基金管理人预先开设的基金募集专户。

6、认购确认：在基金合同生效后，投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

（十二）网下股票认购

1、认购时间：网下股票认购的日期为2014年6月23日至2014年7月11日。

2、认购限额：网下股票认购以单只股票股数申报，投资者应以A股账户认购。用以认购的股票必须是标的指数成份股和已公告的备选成份股（基金管理人公告限制的除外）。单只股票最低认购申报股数为1,000股，超过1,000股的部分须为100股的整数倍。投资者可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

3、认购手续：投资人认购本基金时，需按销售机构的规定，到基金销售网点办理认购手续，并备足认购股票。网下股票认购申请一经受理不得撤销，投资人申报的股票予以冻结。投资人的认购股票在网下股票认购日至登记机构进行股票过户日（不含）的冻结期间所产生的权益归投资人所有。

4、特别提示：投资人应根据法律法规及证券交易所相关规定进行股票认购，并及时履行因股票认购导致的股份减持所涉及的信息披露等义务。

5、特殊情形

(1)已公告的将被调出标的指数的成份股不得用于认购本基金。

(2)限制个股认购规模：基金管理人可根据网下股票认购日前3个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购日前至少3日公告限制认购规模的个股名单。

(3)临时拒绝个股认购：对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。

(4)募集结束前，如中证指数有限公司公告调整标的指数成份股，则公告中的调入名单将也纳入认购清单。

6、清算交收：T日日终（T日为本基金发售期最后一日），发售代理机构将股票认购数据按投资者证券账户汇总发送给基金管理人，基金管理人初步确认各成份股的有效认购数量。T+1日起，登记结算机构根据基金管理人提供的确认数据将投资者上海市场网下认购股票进行冻结，并将投资者深圳市场网下认购股票过户至中国证券登记结算有限公司深圳分公司的证券认购专户。以基金份额方式支付佣金的，基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的佣金，并从投资者的认购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额。登记结算机构根据基金管理人提供的有效认购申请股票数据，将上海市场和深圳市场的股票过户至本基金的证券账户。基金合同生效后，登记结算机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记。

7、认购份额的计算公式

投资者的认购份额＝$\sum_i$（第i只股票在网下股票认购期最后一日的均价×有效认购数量）/1.00

其中，

（1）i代表投资者提交认购申请的第i只股票，如投资者仅提交了1只股票的申请，则i=1。

（2）“第i只股票在网下股票认购期最后一日的均价”由基金管理人根据上海证券交易所的当日行情数据，以该股票的总成交金额除以总成交股数计算，以四舍五入的方法保留小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交，则认同样方法计算最近交易日的均价作为计算价格。

若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则由于投资者获得了相应的权益，基金管理人将按如下方式对该股票在网下股票认购期最后一日的均价进行调整：

①除息：调整后价格=网下股票认购期最后一日均价-每股现金股利或股息

②送股：调整后价格=网下股票认购期最后一日均价/（1+每股送股比例）

③配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例）/（1+每股配股比例）

④送股且配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例）/（1+每股送股比例+每股配股比例）

⑤除息、送股且配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例-每股现金股利或股息）/（1+每股送股比例+每股配股比例）

（3）“有效认购数量”是指由基金管理人确认的并由登记结算机构进行清算交收的股票股数。其中，

①对于经公告限制认购规模的个股，基金管理人可确认的认购数量上限为：

$$q^{max} = (Cash + \sum_{j=1}^{n} p_j q_j) \times 105\% \times w \ / \ p$$

q^{max}为限制认购规模的单只个股最高可确认的认购数量，$Cash$为网上现金认购和网下现金认购的合计申请数额，$p_j q_j$为除限制认购规模的个股和基金管理人全部或部分临时拒绝的个股以外的其他个股在网下股票认购期最后一日的均价和认购申报数量乘积，w为该股按均价计算的其在网下股票认购期最后一日基金标的指数中的权重（认购期间如有其标的指数调整公告，则基金管理人根据公告调整后的成份股名单以及标的指数编制规则计算调整后的标的指数权数重，并以其作为计算依据），p为该股在网下股票认购期最后一日的均价。

如果投资人申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限，则按照各投资者的认购申报数量从小到大收取。

②若某一股票在股票认购日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间发生司法执行，则基金管理人将根据登记结算机构确认的实际过户数据对投资者的有效认购数量进行相应调整。

8、认购确认：在基金合同生效后，投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。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。认购的确认以登记结算机构或基金管理人的确认结果为准。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。

（十三）募集资金利息与募集股票权益的处理方式

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金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，其中利息以基金管理人的记录为准。网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资者基金份额。投资者的认购股票在股票认购日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间的权益归投资者所有。

（十四）募集期间的资金、股票的处理方式

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；募集的股票由登记结算机构予以冻结，于基金募集期结束后过户至预先开立的专门账户。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

七、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（含网下股票认购募集的股票市值）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，网下股票认购募集的股票由登记结算机构予以冻结，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。对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票，登记结算机构应予以解冻。

3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及发售代理机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和发售代理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，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

八、基金份额折算与变更登记

为提高交易便利或根据需要（如变更标的指数），基金管理人可向登记结算机构申请办理基金份额折算与变更登记。

基金管理人应事先确定基金份额折算日，并依照《信息披露办法》的有关规定提前公告。

基金份额折算后，基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后，基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。基金管理人应就具体事宜进行必要公告，并提前通知基金托管人。

如果基金份额折算过程中发生不可抗力，基金管理人可延迟办理基金份额折算。

基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

九、基金份额的上市交易

（一）基金份额的上市

基金合同生效后，本基金具备下列条件的，基金管理人可依据《上海证券交易所证券投资基金上市规则》，向上海证券交易所申请上市：

1、基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不低于2亿元。

2、基金份额持有人不少于1000人。

3、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。

本基金上市前，基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。本基金基金份额获准在上海证券交易所上市的，基金管理人应在本基金基金份额上市日前3个工作日发布上市交易公告书。

（二）基金份额的上市交易

基金份额在上海证券交易所的上市交易需遵照《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定。

若上海证券交易所增加交易型开放式指数基金分级业务模式，本基金管理人可与基金托管人协商一致后，增加本基金分级份额，并报中国证监会核准或备案后公告。

（三）IOPV的计算

基金管理人在每一交易日开市前公告当日的申赎赎回清单，中证指数有限公司在开市后根据申购赎回清单和组合证券内各只证券的实时成交数据，计算基金份额参考值（IOPV），并将计算结果向上海证券交易所发送，由上海证券交易所对外发布，仅供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。

1、基金份额参考值计算公式为：

基金份额参考值＝（申购赎回清单中必须用现金替代的替代金额＋申购赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和＋申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和+申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与最新成交价相乘之和＋申购赎回清单中的预估现金部分）/最小申购、赎回单位对应的基金份额。

2、基金份额参考值的计算以四舍五入的方法保留小数点后3位。

3、基金管理人可以调整基金份额参考值计算公式，并予以公告。

（四）终止上市交易

基金份额上市交易后，有下列情形之一的，上海证券交易所可终止基金的上市交易，并报中国证监会备案：

1、不再具备本条第一款规定的上市条件。

2、基金合同终止。

3、基金份额持有人大会决定提前终止上市。

4、基金合同约定的终止上市的其他情形。

5、上海证券交易所认为应当终止上市的其他情形。

若因上述1、3、4、5项等原因使本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的，本基金可由交易型开放式基金变更为跟踪标的指数的非上市的开放式指数基金，而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，履行适当的程序后选取其他合适的指数作为标的指数。

（五）法律法规、监管部门和上海证券交易所对上市交易另有规定的，从其规定。

（六）在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致后，可申请在其他证券交易所同时挂牌交易，而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

（一）申购和赎回场所

投资人应当在申购赎回代理机构办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理机构提供的其他方式办理基金的申购和赎回。基金管理人将在开放申购、赎回业务之前公告申购赎回代理机构的名单。基金管理人可根据情况变更或增减申购赎回代理机构，并予以公告。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资人可办理基金份额的申购和赎回的开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日，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。开放时间为上海证券交易所和深圳证券交易所的交易时间。

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实际情况需要，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体上公告。

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个月开始办理申购或赎回。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

（三）申购与赎回的原则

1、基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。

2、基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

3、申购、赎回申请提交后不得撤销。

4、申购、赎回应遵守《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》的规定。

5、基金管理人可在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，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体上公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请的提出

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

投资人申购基金份额时，必须根据相应的申购赎回清单备足申购对价。投资人在提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

2、申购和赎回申请的确认

投资人申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资人未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资人持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。

投资人申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；即在目前结算规则下，T日申购的基金份额当日可卖出，T日申购当日未卖出的基金份额，T+1日不得卖出和赎回，T+1日交收成功后T+2日可卖出和赎回。投资人赎回获得的股票当日可卖出。

申购赎回代理机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表申购赎回代理机构确实接收到该申请。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、赎回申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定。

对于本基金的申购业务采用净额结算和逐笔全额结算相结合的方式，其中上交所上市的成份股的现金替代、申购当日并卖出的基金份额及对应的深交所上市的成份股的现金替代采用净额结算，申购当日未卖出的基金份额及对应的深交所上市的成份股的现金替代采用逐笔全额结算；对于本基金的赎回业务采用净额结算和代收代付相结合的方式，其中上交所上市的成份股的现金替代采用净额结算，深交所上市的成份股的现金替代采用代收代付；本基金上述申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。

投资者T日申购成功后，登记结算机构在T日收市后为投资者办理申购当日卖出基金份额与上交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在T+1日办理申购当日未卖出基金份额与现金替代的交收以及现金差额的清算，在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理机构、基金管理人和基金托管人。现金替代交收失败的，该笔申购当日未卖出基金份额交收失败。

投资者T日赎回成功后，登记结算机构在T日收市后为投资者办理基金份额的注销与上交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在T+1日办理上交所上市的成分股现金替代的交收以及现金差额的清算，在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理机构、基金管理人和基金托管人。基金管理人不迟于T+3日办理赎回的深交所上市的成份股现金替代的交付。

如果登记结算机构和基金管理人在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定进行处理。

基金管理人、登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对上述申购赎回的程序以及清算交收和登记的办理时间、方式、处理规则等进行调整，并最迟于开始实施前3个工作日在指定媒体公告。

投资者应按照基金合同的约定和申购赎回代理机构的规定按时足额支付应付的现金差额和现金替代补款。因投资者原因导致现金差额或现金替代补款未能按时足额交收的，基金管理人有权为基金的利益向该投资者追偿，并要求其承担由此导致的其他基金份额持有人或基金资产的损失。

（五）申购和赎回的数额限制

投资人申购、赎回的基金份额需为基金最小申购、赎回单位的整数倍。目前，本基金最小申购、赎回单位为50万份。

基金管理人可根据基金运作情况、市场变化以及投资人需求等因素对基金的最小申购、赎回单位进行调整并提前公告。

（六）申购和赎回的对价、费用及其用途

1、申购对价是指投资人申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数额确定。

2、投资人在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理机构可按照不超过0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

3、T日的基金份额净值在当日收市后计算，并在T+1日内公告，计算公式为估值日基金资产净值除以估值日基金份额总数。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

4、T日的申购赎回清单在当日上海证券交易所开市前公告。未来，若市场情况发生变化，或相关业务规则发生变化，基金管理人可以在不违反相关法律法规的情况下对基金份额净值、申购赎回清单计算和公告时间进行调整并提前公告。

（七）申购赎回清单的内容与格式

1、申购赎回清单的内容

T日申购赎回清单公告内容包括最小申购、赎回单位所对应的组合证券内各成份证券数据、现金替代、T日预估现金部分、T-1日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

2、组合证券相关内容

组合证券是指基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购、赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

3、现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。

（1）现金替代分为4种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）、必须现金替代（标志为“必须”）和退补现金替代（标志为“退补”）。

禁止现金替代适用于上交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代适用于上交所上市的成份股，是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

必须现金替代适用于所有成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用固定现金作为替代。

退补现金替代适用于深交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人实头情况，与投资者进行退款或补款。

（2）可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券。目前仅适用于标的指数中的上交所股票。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额＝替代证券数量×该证券参考价格×（1＋现金替代溢价比例）

其中，“参考价格”目前为该证券前一交易日除权除息后的收盘价。如果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。

收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的最新价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

③替代金额的处理程序

T日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代溢价比例，并据此收取替代金额。

在T日后被替代的成份证券有正常交易的2个交易日（简称为T+2日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。T+2日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照T+2日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

特例情况：若自T日起，深圳证券交易所正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于2日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

若现金替代日（T日）后至T+2日期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

T+2日后第1个工作日（若在特例情况下，则为T日起第21个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理机构和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后3个工作日内完成。

4、预估现金部分相关内容

预估现金部分是指为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理机构预先冻结申请申购赎回的投资者的相应资金，由基金管理人计算的现金数额。

T日申购赎回清单中公告T日预估现金部分。其计算公式为：

T日预估现金部分＝T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值－（申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额＋申购赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与相应证券调整后T日开盘参考价相乘之和＋申购赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与相应证券调整后T日开盘参考价相乘之和+申购赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与相应证券调整后T日开盘参考价相乘之和）

其中，该证券调整后T日开盘参考价主要根据中证指数有限公司提供的标的指数成份证券的调整后开盘参考价确定。另外，若T日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金部分的数值可能为正、为负或为零。

5、现金差额相关内容

T日现金差额在T+1日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：

T日现金差额＝T日最小申购赎回单位的基金资产净值－（申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额＋申购赎回清单中各退补现金替代成份证券的数量与相应证券T日收盘价相乘之和＋申购赎回清单中各可以现金替代成份证券的数量与相应证券T日收盘价相乘之和＋申购赎回清单中各禁止现金替代成份证券的数量与相应证券T日收盘价相乘之和）

T日投资者申购赎回基金份额时，需按T+1日公告的T日现金差额进行资金的清算交收。

现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资者申购时，如现金差额为正数，则投资者应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资者将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资者赎回时，如现金差额为正数，则投资者将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

6、申购赎回清单的格式

申购赎回清单的格式举例如下：

基本信息

最新公告日期	2014-06-17
基金名称	景顺长城中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	景顺长城基金管理有限公司
一级市场基金代码	

2014年6月16日信息内容

现金差额(单位:元)	
最小申购赎回单位资产净值(单位:元)	500,000.00
基金份额净值(单位:元)	1.0000

2014年6月17日信息内容

预估现金(单位:元)	348.00
最小申购赎回单位(单位:份)	500,000
是否需要公布IOPV	是
现金替代比例上限	30%
是否允许申购和赎回	允许申购、允许赎回

组合证券替代信息内容

股票代码	股票简称	股票数量	现金替代标志	现金替代溢价比例	固定现金替代
000423	东阿阿胶	600	退补	10%	19182
000513	丽珠集团	100	退补	10%	4700
000518	四环生物	1200	退补	10%	3936
000538	云南白药	600	退补	10%	32634
000566	海南海药	400	退补	10%	4336
000623	吉林敖东	800	退补	10%	12360
000650	仁和药业	700	退补	10%	3360
000788	北大医药	400	退补	10%	5364
000919	金陵药业	300	退补	10%	3894
000999	华润三九	400	退补	10%	7684
002001	新和成	600	退补	10%	7638
002007	华兰生物	300	退补	10%	7866
002022	科华生物	400	退补	10%	8704
002038	双鹭药业	300	退补	10%	13176
002118	紫鑫药业	300	退补	10%	4125
002219	恒康医疗	300	退补	10%	6300
002223	鱼跃医疗	200	退补	10%	5110
002252	上海莱士	100	退补	10%	6330
002275	桂林三金	200	退补	10%	3074
002294	信立泰	200	退补	10%	6004
002317	众生药业	300	退补	10%	5985
002332	仙琚制药	400	退补	10%	3236
002393	力生制药	100	退补	10%	2945
002399	海普瑞	300	退补	10%	5685
002422	科伦药业	300	退补	10%	11616
002424	贵州百灵	200	退补	10%	4980
002437	誉衡药业	100	退补	10%	5394
002551	尚荣医疗	200	退补	10%	6802
002603	以岭药业	100	退补	10%	3056
002653	海思科	200	退补	10%	3622
600062	华润双鹤	400	允许	10%	
600079	人福医药	500	允许	10%	
600085	同仁堂	700	允许	10%	
600161	天坛生物	300	允许	10%	
600195	中牧股份	200	允许	10%	
600196	复星医药	1300	允许	10%	
600201	金宇集团	300	允许	10%	
600216	浙江医药	700	允许	10%	
600252	中恒集团	1000	允许	10%	
600267	海正药业	600	允许	10%	
600276	恒瑞医药	800	允许	10%	
600329	中新药业	200	允许	10%	
600332	白云山	600	允许	10%	
600351	亚宝药业	600	允许	10%	
600380	健康元	700	允许	10%	
600422	昆明制药	300	允许	10%	
600436	片仔癀	100	允许	10%	
600479	千金药业	200	允许	10%	
600488	天药股份	600	允许	10%	
600521	华海药业	500	允许	10%	
600535	天士力	700	允许	10%	
600557	康缘药业	300	允许	10%	
600566	洪城股份	200	允许	10%	
600572	康恩贝	500	允许	10%	
600587	新华医疗	200	允许	10%	
600614	鼎立股份	300	允许	10%	
600645	中源协和	300	允许	10%	
600664	哈药股份	1100	允许	10%	
600750	江中药业	200	允许	10%	
600812	华北制药	900	允许	10%	
600867	通化东宝	800	允许	10%	

说明：此表仅为示意，以实际公布的为准。

（八）拒绝或暂停申购、赎回的情形

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、赎回申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作或基金管理人无法受理投资者的申购、赎回申请。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

3、上海证券证券交易所、深圳证券交易所交易时间临时停市或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、相关证券交易所、登记结算机构、申购赎回代理机构等因异常情况无法办理申购、赎回业务。

5、基金管理人开市前未能公布申购赎回清单。

6、因异常情况导致申购赎回清单无法编制或编制不当。

7、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