

## 信息披露 Disclosure

## (上接A14版)

2.基金管理人可设定申购赎回上限和赎回份额上限,对当日的申购赎回规模赎回已履行控制,并在申购赎回清单中公告。

3.基金管理人可对单一投资者累计持有的基金份额上限,基金管理人可对单一投资者买入持有基金份额净值不超过上限。

4.接受申购申请对基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购份额上限或基金单日申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益,具体处理原则参见相关公告。

5.基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述申购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)申购赎回的时间

1.申购对价、赎回对价按照申购赎回清单和投资人申购、赎回的基金份额数量确定。申购对价是指投资人申购基金份额应付的对价组合,现金对价、基金份额对价,赎回对价是指基金份额持有人赎回基金份额应付的对价组合,现金对价、基金份额对价及其他对价。申购赎回清单由基金管理人编制,于每个交易日前开放申购前公告。

2. T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日公告,计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数,精确到0.0001元,小数点后第四位四舍五入。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。

3.投资人在申购或赎回基金份额时,申购赎回代理券商可按照不超过0.5%的标准收取佣金,其中包含申购费,登记结算机构等收取的相关费用。

(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、赎回单位及对应的组合内各券成份证券数据、现金对价、T日预估现金部分、T-1日预估现金、基金份额净值及其他相关内容。

组合内各券成份证券的名称组合内各券成份证券名称、申购赎回清单公告最小申购赎回单位对应的各券成份证券名称、证券代码及名称。

3.现金对价相关内容

现金对价指投资人申购、赎回过程中,投资人按基金合同和招募说明书的规定,用于替代组合中部分证券的一定数量的现金。

现金对价分为两种类型: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”)和必须现金替代(标志为“替代”)。

禁止现金替代适用于上海证券交易所上市的成份股,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海证券交易所上市的成份股,是指在申购、赎回基金份额时,允许使用现金作为全部或部分成份证券的替代,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现金作为替代。

1.可以现金替代

(1)申购适用:由于证券停牌等原因导致投资人无法在申购日买入证券或基金管理人认为以可以适用的其他方式,目前仅适用于沪深300指数中的上海证券交易所上市的成份股。现金替代类型为“可以现金替代”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,“该证券参考价格”定义为“该证券前一交易日除权除息后的收盘价”,如上海证券交易所所有证券参考价格按照收盘价确定,上海证券交易所指定证券的参考价格,基金管理人可在证券批发市场交易买入,而买入买入的价格上附加相关费用用于与申购的最低成交价格有所差异,为方便操作,基金管理人可在申购赎回清单中预先设定现金替代溢价比例,并据此收取现金替代。如果未来该证券的收盘价高于申购日的参考价格,则会现金替代投资者取得溢利的差额;如果未来该证券的收盘价低于基金管理人该部分证券的实际成本,则基金管理人将向投资者收取溢利的差额。

T日,基金管理人将在申购赎回清单公布现金替代溢价比例,并据此收取现金替代金额。

在T日后被赎回的2个交易日(T+2)内,基金管理人将以收到的现金购买现金替代证券并支付现金替代对价。

T+2日赎回,若已购入全部被替代证券,则以替代证券全部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,确定基金现金替代买入或卖出的款项;若未能购入全部被替代证券,则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本(包括买入价格与交易费用)的差额,确定基金现金替代买入或卖出的款项。

替代对价:对于必须现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(2)赎回适用:必须现金替代的证券一般是出于保护基金份额持有人利益等目的基金管理人认为有必要,必须现金替代的成份证券。

替代对价:对于必须现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(3)部分现金替代

部分现金替代指基金管理人认为有必要,部分现金替代的成份证券。

替代对价:对于部分现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(4)禁止现金替代

禁止现金替代指基金管理人认为有必要,禁止现金替代的成份证券。

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(5)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(6)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(7)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(8)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(9)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(10)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(11)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(12)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(13)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(14)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(15)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(16)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(17)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(18)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(19)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(20)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(21)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(22)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(23)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(24)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(25)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(26)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(27)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(28)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(29)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(30)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(31)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(32)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(33)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(34)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(35)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(36)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(37)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(38)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(39)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(40)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(41)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(42)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(43)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(44)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(45)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(46)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(47)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(48)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(49)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(50)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(51)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(52)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(53)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

(54)替代金额的计算

替代对价:对于禁止现金替代的证券,基金管理人将在申购赎回清单公告替代的一定数量的现金,即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以该证券的参考价格。

000227	汾酒转债	2100	债券转股	10%	11094
000232	苏农转债	1000	债券转股	10%	5284
000244	美年转债	500	债券转股	10%	7475
000260	三花转债	300	债券转股	10%	3807
000265	东华转债	300	债券转股	10%	3475
000281	金麒麟	500	债券转股	10%	4050
000285	万丰转债	400	债券转股	10%	3100
000320	汾酒转债	100	债券转股	10%	3030
000322	苏农转债	100	债券转股	10%	12376
000326	金麒麟	600	债券转股	10%	2975
000328	三花转债	100	债券转股	10%	2526
000329	东华转债	100	债券转股	10%	6903
000330	中航转债	100	债券转股	10%	6903
000332	金麒麟	700	债券转股	10%	4128
000336	万丰转债	400	债券转股	10%	3294
000338	苏农转债	100	债券转股	10%	2889
000339	东华转债	200	债券转股	10%	18944
000340	三花转债	100	债券转股	10%	2794
000341	东华转债	400	债券转股	10%	4634
000342	美年转债	100	债券转股	10%	3275
000343	东华转债	100	债券转股	10%	2108
000345	东华转债	1100	债券转股	10%	2636
000346	东华转债	100	债券转股	10%	4130
000348	东华转债	600	债券转股	10%	4884
000349	东华转债	500	债券转股	10%	4595
000350	东华转债	200	债券转股	10%	4416
000351	东华转债	200	债券转股	10%	1284
000352	东华转债	100	债券转股	10%	1645
000353	东华转债	700	债券转股	10%	9842
000354	东华转债	400	债券转股	10%	4038
000355	东华转债	100	债券转股	10%	2019
000356	东华转债	100	债券转股	10%	1888
000357	东华转债	100	债券转股	10%	3874
000358	东华转债	200	债券转股	10%	3250
000359	东华转债	300	债券转股	10%	15300
000360	东华转债	200	债券转股	10%	2960
000361	东华转债	100	债券转股	10%	2775
000362	东华转债	100	债券转股	10%	2925
000363	东华转债	100	债券转股	10%	3828
000364	东华转债	100	债券转股	10%	5670
000365	东华转债	100	债券转股	10%	1302
000366	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000367	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000368	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000369	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000370	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000371	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000372	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000373	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000374	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000375	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000376	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000377	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000378	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000379	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000380	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000381	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000382	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000383	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000384	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000385	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000386	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000387	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000388	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000389	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000390	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000391	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000392	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000393	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000394	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000395	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000396	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000397	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000398	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000399	东华转债	3400	债券转股	10%	3400
000400	东华转债	3400	债券转股	10%	3400

000138	中国平安	7500	允许	10%	1000
000139	华泰证券	2000	允许	10%	1000
000133	广发证券	2000	允许	10%	1000
000136	新华保险	200	允许	10%	1000
000130	三六零	100	允许	10%	1000
000177	兴业证券	1400	允许	10%	1000
000130	中国平安	2000	允许	10%	1000
000138	中国平安	6200	允许	10%	1000
000155	华泰证券	700	允许	10%	1000
000156	华泰证券	1800	允许	10%	1000
000161	光大证券	300	允许	10%	1000
000167	上海证券	300	允许	10%	1000
000161	中国建投	200	允许	10%	1000
000168	中国中投	200	允许	10%	1000
000168	中国中投	500	允许	10%	1000
000168	中国中投	100	允许	10%	1000
000163	长城证券	300	允许	10%	1000
000168	中国建投	6100	允许	10%	1000
000169	中国建投	1800	允许	10%	1000
000169	中国建投	1900	允许	10%	1000
000174					