（上接A18版）

价，与场内申购、赎回所支付、取得的对价方式不同。投资者可自行判断并选择适合自身的申购赎回场所、方式。

（十）申购、赎回清单的内容与格式

申购、赎回清单适用于本基金的场内申购、赎回业务。

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

组合证券是指本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，根据基金管理人买卖情况，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。目前仅适用于沪深300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”的确定原则为

i）该证券正常交易时，采用最新成交价；

ii）该证券正常交易中出现涨停时，采用涨停价格；

iii）该证券停牌且当日有成交时，采用最新成交价；

iv）该证券停牌且当日无成交时，采用前一交易日收盘价（考虑当日的除权除息等因素）。

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高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，上海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（若在特例情况下，则为 T 日起第 20 个交易日）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券商和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。

④替代限制：为有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，基金管理人可规定投者使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为：

参考基金份额净值日前为最新基金份额参考净值。如果上海证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考基金份额净值为准。

3）必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证券以及处于停牌的股票。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购、赎回清单中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其调整后 T 日开盘参考价。

4）退补现金替代

①适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于沪深 300 指数中深交所股票。

②替代金额：对于退补现金替代的证券，替代金额的计算公式为：申购的替代金额=替代证券数量×该证券调整后 T 日开盘参考价×（1+现金替代溢价比例）；

赎回的替代金额=替代证券数量×该证券调整后 T 日开盘参考价×（1-现金替代溢价比例）。

③替代金额的处理程序对退补现金替代而言，申购时收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将买入该证券，实际买入价格加上相关交易费用后与该证券调整后 T 日开盘参考价可能有所差异。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高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。

对退补现金替代而言，赎回时扣除现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将卖出该证券，实际卖出价格扣除相关交易费用后与该证券调整后 T 日开盘参考价可能有所差异。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，并据此支付替代金额。如果预先支付的金额低于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将退还少支付的差额；如果预先支付的金额高于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将向投资者收取多支付的差额。

其中，调整后 T 日开盘参考价主要根据中证指数公司提供的标的指数成份证券的调整后开盘参考价确定。

基金管理人将自 T 日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的部分证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次卖出赎回被替代的部分证券。T 日未完成的交易，基金管理人在 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）内完成上述交易。

时间优先的原则为：申购赎回方向相同的，先确认成交者优先于后确认成交者。先后顺序按照上交所确认申购赎回的时间确定。

实时申报的原则为：基金管理人在深交所连续竞价期间，根据收到的上交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深交所申报被替代证券的交易指令。

T 日基金管理人按照“时间优先”的原则依次与申购投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照申购时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；按照“时间优先”的原则依次与赎回投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照赎回时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

对于 T 日因停牌或流动性不足等原因未购入和未卖出的被替代的部分证券，T 日后基金管理人可以继续进行被替代证券的买入和卖出，按照前述原则确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

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，确定基金应退还申购投资者或申购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（包括买入价格与交易费用）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，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项。

T+2日日终，若已卖出全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项；若未能卖出全部被替代的证券，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照 T+2日收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回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（包括买入价格与交易费用）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，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回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，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券商和基金托管人，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券商预先冻结申请申购、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该证券调整后 T 日开盘参考价相乘之和+申购、赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与该证券调整后 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该证券调整后 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、赎回清单中退补现金替代成份证券的数量与 T 日收盘价相乘之和+申购、赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与 T 日收盘价相乘之和+申购、赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与 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	2012-9-28
基金名称	易方达沪深 300 交易型开放式指数基金
基金管理公司名称	易方达基金管理有限公司
一级市场基金代码	510311

2012年9月27日信息内容

现金差额(单位：元)	1010.27
最小申购、赎回单位资产净值(单位：元)	2,000,000.00
基金份额净值(单位：元)	1.000

2012年9月28日信息内容

预估现金部分(单位：元)	-5866.00
现金替代比例上限	30%
是否需要公布 IOPV	是
最小申购、赎回单位(单位：份)	2,000,000
申购、赎回的允许情况	允许申购，允许赎回

成份股信息内容

股票代码	股票简称	股票数量	现金替代标志	现金溢价比例	固定替代金额
000001	平安银行	1100	退补	10%	14333.00
000002	万科A	4300	退补	10%	35303.00
000009	中国宝安	500	退补	10%	4355.00
000012	南 玻A	600	退补	10%	4176.00
000021	长城开发	300	退补	10%	1473.00
000024	招商地产	300	退补	10%	6030.00
000039	中集集团	400	退补	10%	3956.00
000046	泛海建设	600	退补	10%	2142.00
000059	辽通化工	300	退补	10%	1767.00
000060	中金岭南	600	退补	10%	4812.00
000061	农 产 品	500	退补	10%	2795.00
000063	中兴通讯	900	退补	10%	9522.00
000069	华侨城A	1600	退补	10%	8752.00
000100	TCL集团	3800	退补	10%	7106.00
000157	中联重科	1900	退补	10%	16017.00
000338	潍柴动力	400	退补	10%	7560.00
000401	冀东水泥	200	退补	10%	2360.00
000402	金 融 街	1100	退补	10%	6523.00
000422	湖北宜化	300	退补	10%	3576.00
000423	东阿阿胶	200	退补	10%	7770.00
000425	徐工机械	500	退补	10%	5190.00
000527	美的电器	900	退补	10%	8262.00
000528	柳工	300	退补	10%	2547.00
000538	云南白药	200	退补	10%	12206.00
000559	万向钱潮	400	退补	10%	1704.00
000562	宏源证券	300	退补	10%	5667.00
000568	泸州老窖	300	退补	10%	11250.00
000581	威孚高科	200	退补	10%	4948.00
000623	吉林敖东	300	退补	10%	4407.00
000625	长安汽车	800	退补	10%	4184.00
000629	攀钢钒钛	1900	退补	10%	7068.00
000630	铜陵有色	300	退补	10%	5784.00
000651	格力电器	900	退补	10%	18927.00
000680	山推股份	400	退补	10%	1904.00
000686	东北证券	100	退补	10%	1603.00
000703	恒逸石化	200	退补	10%	2264.00
000709	河北钢铁	1900	退补	10%	4389.00
000718	苏宁环球	400	退补	10%	2268.00
000725	京东方A	3800	退补	10%	7182.00
000728	国元证券	400	退补	10%	4596.00
000729	燕京啤酒	600	退补	10%	3114.00
000758	中色股份	200	退补	10%	4210.00
000768	西飞国际	500	退补	10%	3565.00
000776	广发证券	100	必须		1340.00
000778	新兴铸管	400	退补	10%	2396.00
000780	平庄能源	200	退补	10%	2090.00
000783	长江证券	700	退补	10%	6342.00
000792	盐湖股份	300	退补	10%	8598.00
000800	一汽轿车	400	退补	10%	2632.00
000807	云铝股份	400	退补	10%	2020.00
000825	太钢不锈	1000	退补	10%	3330.00
000839	中信国安	400	退补	10%	2468.00
000858	五 粮 液	800	退补	10%	26640.00
000869	张 裕A	100	退补	10%	4556.00
000876	新 希 望	200	退补	10%	2490.00
000878	云南铜业	300	退补	10%	4959.00
000895	双汇发展	100	退补	10%	5850.00
000898	鞍钢股份	800	退补	10%	2728.00
000933	神火股份	400	退补	10%	3240.00
000937	冀中能源	300	退补	10%	3774.00
000960	锡业股份	200	退补	10%	4014.00
000961	中南建设	200	退补	10%	1776.00
000968	煤气化	100	退补	10%	1364.00
000969	安泰科技	200	退补	10%	2500.00
000983	西山煤电	700	退补	10%	9310.00
000999	华润三九	200	退补	10%	4528.00
002001	新和成	200	退补	10%	3656.00
002007	华兰生物	100	退补	10%	2552.00
002024	苏宁电器	2000	退补	10%	12700.00
002038	双鹭药业	100	退补	10%	3483.00
002069	獐子岛	100	退补	10%	1713.00
002073	软控股份	300	退补	10%	2349.00
002081	金螳螂	100	退补	10%	3578.00
002092	中泰化学	400	退补	10%	2984.00
002106	莱宝高科	200	退补	10%	3278.00
002122	天马股份	300	退补	10%	1695.00
002128	露天煤业	200	退补	10%	2566.00
002142	宁波银行	500	退补	10%	4480.00
002146	荣盛发展	200	退补	10%	1686.00
002155	辰州矿业	200	退补	10%	4228.00
002202	金风科技	700	退补	10%	3934.00
002241	歌尔声学	200	退补	10%	7336.00
002299	圣农发展	200	退补	10%	2316.00
002304	洋河股份	100	退补	10%	12200.00
002310	东方园林	100	退补	10%	5777.00
002344	海宁皮城	100	退补	10%	2495.00
002353	杰瑞股份	100	退补	10%	4360.00
002378	章源钨业	100	退补	10%	2565.00
002385	大北农	200	退补	10%	4188.00
002399	海普瑞	100	退补	10%	1980.00
002405	四维图新	200	退补	10%	2512.00
002415	海康威视	200	退补	10%	5420.00
002422	科伦药业	100	退补	10%	4868.00
002431	棕榈园林	100	退补	10%	2250.00
002493	荣盛石化	100	退补	10%	1172.00
002500	山西证券	300	退补	10%	2457.00
002570	贝因美	100	退补	10%	2075.00
002594	比亚迪	100	退补	10%	1413.00
002603	以岭药业	100	退补	10%	2750.00
600000	浦发银行	5000	允许	10%	
600005	武钢股份	1800	允许	10%	
600009	上海机场	400	允许	10%	
600010	包钢股份	1100	允许	10%	
600011	华能国际	1400	允许	10%	
600015	华夏银行	1500	允许	10%	
600016	民生银行	10000	允许	10%	
600019	宝钢股份	2300	允许	10%	
600022	山东钢铁	900	允许	10%	
600028	中国石化	1900	允许	10%	
600029	南方航空	1600	允许	10%	
600030	中信证券	3300	允许	10%	
600031	三一重工	1300	允许	10%	
600036	招商银行	5500	允许	10%	
600037	歌华有线	300	允许	10%	
600048	保利地产	1900	允许	10%	
600050	中国联通	3800	允许	10%	
600058	五矿发展	200	允许	10%	
600062	华润双鹤	200	允许	10%	
600066	宇通客车	200	允许	10%	
600068	葛洲坝	900	允许	10%	
600085	同仁堂	300	允许	10%	
600089	特变电工	1200	允许	10%	
600096	云天化	100	允许	10%	
600100	同方股份	700	允许	10%	
600104	上汽集团	1000	允许	10%	
600108	亚盛集团	600	允许	10%	
600109	国金证券	200	允许	10%	
600111	包钢稀土	600	允许	10%	
600115	东方航空	1000	允许	10%	
600118	中国卫星	200	允许	10%	
600123	兰花科创	300	允许	10%	
600125	铁龙物流	400	允许	10%	
600132	重庆啤酒	100	允许	10%	
600143	金发科技	800	允许	10%	
600150	中国船舶	200	允许	10%	
600153	建发股份	600	允许	10%	
600160	巨化股份	300	允许	10%	
600166	福田汽车	600	允许	10%	
600169	太原重工	800	允许	10%	
600170	上海建工	300	允许	10%	
600177	雅戈尔	600	允许	10%	
600183	生益科技	100	允许	10%	
600188	兖州煤业	400	允许	10%	
600196	复星医药	500	允许	10%	
600208	新湖中宝	800	允许	10%	
600216	浙江医药	100	允许	10%	
600219	南山铝业	500	允许	10%	
600221	海南航空	500	允许	10%	
600252	中恒集团	200	允许	10%	
600256	广汇能源	900	允许	10%	
600259	广晟有色	100	允许	10%	
600266	北京城建	200	允许	10%	
600267	海正药业	200	允许	10%	
600271	航天信息	200	允许	10%	
600276	恒瑞医药	200	允许	10%	
600307	酒钢宏兴	400	允许	10%	
600309	烟台万华	500	允许	10%	
600315	上海家化	100	允许	10%	
600316	洪都航空	200	允许	10%	
600320	振华重工	800	允许	10%	
600331	宏达股份	400	允许	10%	
600348	阳泉煤业	500	允许	10%	
600352	浙江龙盛	500	允许	10%	
600362	江西铜业	400	允许	10%	
600369	西南证券	500	允许	10%	
600372	中航电子	200	允许	10%	
600376	首开股份	300	允许	10%	
600383	金地集团	2000	允许	10%	
600395	盘江股份	200	允许	10%	
600406	国电南瑞	400	允许	10%	
600415	小商品城	600	允许	10%	
600418	江淮汽车	400	允许	10%	
600432	吉恩镍业	200	允许	10%	
600456	宝钛股份	100	允许	10%	
600489	中金黄金	700	允许	10%	
600497	驰宏锌锗	300	允许	10%	
600498	烽火通信	100	允许	10%	
600500	中化国际	300	允许	10%	
600508	上海能源	100	允许	10%	
600516	方大炭素	300	允许	10%	
600518	康美药业	700	允许	10%	
600519	贵州茅台	200	允许	10%	
600528	中铁二局	300	允许	10%	
600535	天士力	100	允许	10%	
600546	山煤国际	100	允许	10%	
600547	山东黄金	300	允许	10%	
600549	厦门钨业	100	允许	10%	
600550	天威保变	300	允许	10%	
600583	海油工程	900	允许	10%	
600585	海螺水泥	900	允许	10%	
600588	用友软件	200	允许	10%	
600595	中孚实业	300	允许	10%	
600598	北大荒	300	允许	10%	
600600	青岛啤酒	200	允许	10%	
600642	申能股份	1300	允许	10%	
600649	城投控股	700	允许	10%	
600655	豫园商城	500	允许	10%	
600660	福耀玻璃	600	允许	10%	
600664	哈药股份	400	允许	10%	
600674	川投能源	400	允许	10%	
600690	青岛海尔	700	允许	10%	
600694	大商股份	100	允许	10%	
600703	三安光电	300	允许	10%	
600718	东软集团	400	允许	10%	
600739	辽宁成大	600	允许	10%	
600741	华域汽车	500	允许	10%	
600770	综艺股份	300	允许	10%	
600779	水井坊	200	允许	10%	
600783	鲁信创投	100	允许	10%	
600795	国电电力	3400	允许	10%	
600804	鹏博士	600	允许	10%	
600809	山西汾酒	100	允许	10%	
600811	东方集团	600	允许	10%	
600812	华北制药	400	允许	10%	
600827	友谊股份	300	允许	10%	
600832	东方明珠	700	允许	10%	
600837	海通证券	3900	允许	10%	
600839	四川长虹	1600	允许	10%	
600859	王府井	100	允许	10%	
600863	内蒙华电	300	允许	10%	
600873	梅花集团	400	允许	10%	
600875	东方电气	300	允许	10%	
600881	亚泰集团	800	允许	10%	
600887	伊利股份	700	允许	10%	
600893	航空动力	200	允许	10%	
600895	张江高科	300	允许	10%	
600900	长江电力	2200	允许	10%	
600970	中材国际	200	允许	10%	
600971	恒源煤电	200	允许	10%	
600997	开滦股份	300	允许	10%	
600999	招商证券	1300	允许	10%	
601001	大同煤业	300	允许	10%	
601006	大秦铁路	2600	允许	10%	
601009	南京银行	900	允许	10%	
601018	宁波港	1700	允许	10%	
601088	中国神华	1500	允许	10%	
601098	中南传媒	200	允许	10%	
601099	太平洋	300	允许	10%	
601101	昊华能源	200	允许	10%	
601106	中国一重	1200	允许	10%	
601111	中国国航	1100	允许	10%	
601117	中国化学	900	允许	10%	
601118	海南橡胶	500	允许	10%	
601158	重庆水务	400	允许	10%	
601166	兴业银行	3300	允许	10%	
601168	西部矿业	800	允许	10%	
601169	北京银行	2300	允许	10%	
601179	中国西电	800	允许	10%	
601186	中国铁建	1400	允许	10%	
601216	内蒙君正	200	允许	10%	
601233	桐昆股份	100	允许	10%	
601258	庞大集团	200	允许	10%	
601268	二重重装	200	允许	10%	
601288	农业银行	11200	允许	10%	
601299	中国北车	1800	允许	10%	
601318	中国平安	1500	允许	10%	
601328	交通银行	10400	允许	10%	
601333	广深铁路	1300	允许	10%	
601336	新华保险	100	允许	10%	
601369	陕鼓动力	200	允许	10%	
601377	兴业证券	700	允许	10%	
601390	中国中铁	2300	允许	10%	
601398	工商银行	6900	允许	10%	
601555	东吴证券	300	允许	10%	
601558	华锐风电	400	允许	10%	
601566	九牧王	100	允许	10%	
601600	中国铝业	1300	允许	10%	
601601	中国太保	1400	允许	10%	
601607	上海医药	400	允许	10%	
601618	中国中冶	2200	允许	10%	
601628	中国人寿	700	允许	10%	
601633	长城汽车	200	允许	10%	
601666	平煤股份	500	允许	10%	
601668	中国建筑	6700	允许	10%	
601669	中国水电	1700	允许	10%	
601688	华泰证券	1000	允许	10%	
601699	潞安环能	400	允许	10%	
601717	郑煤机	400	允许	10%	
601718	际华集团	500	允许	10%	
601766	中国南车	1600	允许	10%	
601788	光大证券	600	允许	10%	
601808	中海油服	300	允许	10%	
601818	光大银行	5400	允许	10%	
601857	中国石油	1500	允许	10%	
601866	中海集运	1100	允许	10%	
601888	中国国旅	100	允许	10%	
601898	中煤能源	800	允许	10%	
601899	紫金矿业	3500	允许	10%	
601901	方正证券	800	允许	10%	
601918	国投新集	200	允许	10%	
601919	中国远洋	1000	允许	10%	
601928	凤凰传媒	300	允许	10%	
601933	永辉超市	100	允许	10%	
601939	建设银行	4300	允许	10%	
601958	金钼股份	400	允许	10%	
601988	中国银行	3000	允许	10%	
601989	中国重工	2000	允许	10%	
601991	大唐发电	900	允许	10%	
601992	金隅股份	400	允许	10%	
601998	中信银行	1200	允许	10%	

（一）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停投资人的申购申请（基金管理人可视情况同时暂停或拒绝场内和场外两种申购方式，也可以只拒绝或暂停其中一种方式）：

1.因不可抗力导致基金管理人无法受理或办理投资人的申购申请；

2.因特殊原因（包括但不限于上海证券交易所或深圳证券交易所依法决定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或无法进行证券交易；

3.发生基金合同规定的暂停基金财产估值情况；

4.基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单；

5.上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构等因异常情况无法办理申购、赎回，或者指数编制单位、上海证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当；

6.基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；

7. 在发生基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时；

8.法律法规、中国证监会或上海证券交易所规定的其他情形。

发生除上述第6 项以外的暂停申购情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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。

（十二）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人的赎回申请或延缓支付赎回款项（基金管理人可同时对场内和场外两种赎回方式实施暂停或延缓支付赎回款项，也可以只针对其中一种方式）：

1.因不可抗力导致基金管理人无法受理或办理基金份额持有人的赎回申请。

2.因特殊原因（包括但不限于上海证券交易所或深圳证券交易所依法决定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或无法进行证券交易。

3.发生基金合同规定的暂停基金财产估值情况。

4. 在发生基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时。

5.法律法规、中国证监会或上海证券交易所规定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付，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并于以公告。

（十