（上接A10版）

联系人：刘毅
网址：www.china-invs.cn
客户服务电话：400-600-8008、95532
（50）中山证券有限责任公司
住所：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
法定代表人：黄扬录
电话：0755-82570586
传真：0755-82960582
联系人：罗艺琳
网址：www.zszq.com
客户服务电话：400-102-2011
（51）西藏同信证券有限责任公司
住所：拉萨市北京中路101号
办公地址：上海市永和路118弄东方企业园24号
法定代表人：贾绍君
电话：021-36533016
传真：021-36533017
联系人：王伟光
网址：www.xzsec.com
客户服务电话：400-881-1177
（52）江海证券有限公司
住所：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人：孙名扬
电话：0451-85863696
传真：0451-82287211
联系人：张背北
网址：www.jhzq.com.cn
客户服务电话：400-666-2288
（53）华宝证券有限责任公司
住所：上海市陆家嘴环路166号27楼
办公地址：上海市陆家嘴环路166号27楼
法定代表人：陈林
电话：021-50122128
传真：021-50122398
联系人：徐方亮
网址：www.cnhbstock.com
客户服务电话：400-820-9898
（54）爱建证券有限责任公司
住所：上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号陆家嘴商务广场32楼
法定代表人：宫龙云
电话：021-32229888
传真：021-62878783
联系人：戴莉丽
网址：www.ajzq.com
客户服务电话：021-63340678
（55）华融证券股份有限公司
住所：北京市西城区月坛北街26号
办公地址：北京西城区金融大街8号A座3层、5层
法定代表人：祝献忠
电话：010-58568235
传真：010-58568062
联系人：黄恒
网址：www.hrsec.com.cn
客户服务电话：010-58568118
（56）山西证券股份有限公司
住所：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
办公地址：山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人：侯巍
电话：0351-8686703
传真：0351-8686619
联系人：张治国
网址：www.i618.com.cn
客户服务电话：400-666-1618
（57）宏信证券有限责任公司
住所：四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
办公地址：四川省成都市锦江区人民南路二段18号川信大厦10楼
法定代表人：吴玉明
电话：028-86199278
传真：028-86199382
联系人：郝俊杰
网址：www.hxzq.cn
客户服务电话：400-836-6366
本基金管理人可以根据情况变化增加或者减少销售机构，并予以公告。销售机构可以根据情况变化增加或者减少其销售城市、网点。

（二）登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
联系人：陈文祥
电话：021-68419095
传真：021-68870311

（三）律师事务所
名称：北京市天元律师事务所
住所：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层
法定代表人：王立华
联系电话：010-57763888
传真：010-57763777
联系人：李晗
经办律师：吴冠雄、李晗

（四）会计师事务所
本公司聘请的法定验资机构为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。
名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市延安东路222号30楼
办公地址：中国北京市东长安街1号东方广场东方经贸城德勤大楼8层
法定代表人：卢伯卿
联系电话：010-85207788
传真：010-85181218
联系人：吕静

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12月3日证监许可[2014]1303号文注册。

（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和网下现金认购2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。
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。

（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12月9日至2014年12月17日进行发售。
其中，办理网上现金认购的日期为2014年12月15日至2014年12月17日，办理网下现金认购的日期为2014年12月9日至2014年12月17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
本基金认购费用由投资者承担，不超过0.08%，认购费率如下表所示：

认购份额	认购费率
50万份以下	0.08%
50万份以上（含50万份）-100万份以下	0.05%
100万份以上（含100万份）	每笔500元

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。

（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，如投资者需要参与基金的申购、赎回，则应开立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：2014年12月15日至2014年12月17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）
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：2014年12月9日至2014年12月17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5万份以上（含5万份）。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×认购份额×认购费率
认购金额＝认购份额×认购份额×（1＋认购费率）
利息折算的份额＝利息/认购份额
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传该投资者提交网上现金认购申请。之后，登记机构进行清算交收，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其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）募集资金利息的处理方式
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。

（十三）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。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，未满足募集生效条件，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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案。
法律法规另有规定时，从其规定。

八、基金份额的交易

（一）基金在上海证券交易所的上市
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。

（二）基金在上海证券交易所的交易
基金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。

（三）基金份额参考净值（IOPV）的计算与公告
基金管理人在每一交易日开市前向中证指数公司提供当日的申购赎回清单，中证指数公司在开市后根据申购赎回清单、香港市场实时行情以及汇率公允价，计算并发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。
1、基金份额参考净值计算公式为：
基金份额参考净值＝（申购赎回清单中必须用现金替代的成份证券的必须替代金额之和+申购赎回清单中退补现金替代的成份证券的数量与最新成交价乘积之和+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（最新成交价按照汇率公允价调整为人民币价格）。
汇率公允价包括中证指数公司在发布和计算境外指数产品中采用的实时汇率价格、基金管理人与基金托管人商定的其他公允价格等。
2、基金份额参考净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净值计算公式，并予以公告。

（四）基金在上海证券交易所终止上市交易的情形
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，在不违反法律法规的前提下，履行适当程序后，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，届时，基金管理人可变更本基金的登记机构并相应调整申购赎回业务规则。
（五）法律法规、监管部门或上海证券交易所对上市交易另有规定的，从其规定。
（六）在不违反法律法规的前提下，本基金可以申请在包括境外交易所在内的其他证券交易所上市交易，无需召开基金份额持有人大会。

九、基金份额的申购与赎回

（一）申购和赎回场所
投资者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
本基金的开放日为港股通交易日，但基金管理人公告暂停申购或赎回等业务时除外。开放日的具体业务办理时间为上海证券交易所的交易时间（如基金开放日为香港联合交易所半日市，则开放日的具体业务办理时间截至上海证券交易所上午连续竞价交易时间结束）。
若证券交易场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申购、赎回的开放日及开放时间进行相应的调整并公告。
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申购开始公告中规定。
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赎回开始公告中规定。
本基金可在基金上市交易之前开始办理申购、赎回，但在基金申请上市期间，可暂停办理申购、赎回；具体申购、赎回业务办理时间在申购、赎回开始公告中规定。
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。

（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、本基金申购、赎回的币种为人民币。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、基金的申购、赎回价格依据招募说明书约定的代理买卖原则确定，与受理申请当日的基金份额净值或有不同。
4、申购、赎回申请提交后不得撤销。
5、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》及其他相关规定。
6、基金管理人可以在不违反法律法规规定的情况下，增加其他币种的申购、赎回，其他币种申购、赎回的具体规则届时将另行公告。
7、未来，在条件允许的情况下基金管理人可以调整基金的申购赎回方式及申购对价、赎回对价组成。
基金管理人可在不违反法律法规的情况下，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。
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。
2、申购和赎回申请的确认
投资者T日的申购、赎回申请在T日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者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。
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现金和基金份额交收适用《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》。
投资者T日申购成功后，登记机构在T日收市后为投资者办理基金份额与现金替代等的交收，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。基金管理人与申购赎回代理机构在T+2日办理现金差额的交收。
投资者T日赎回成功后，登记机构在T日收市后为投资者办理基金份额的交收，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。基金管理人与申购赎回代理机构在T+2日办理现金差额的交收。赎回现金替代款将自有效赎回申请之日起7个开放日内划往基金份额持有人账户。如果出现基金投资市场交易清算规则发生较大变化、基金赎回数额较大或组合证券内的部分证券因停牌、流动性不足等原因导致无法足额卖出，或国家外汇管理相关规定的限制等情况，则赎回款项的清算交收可延迟办理。
如果登记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在至少一种指定媒介公告。

（五）申购与赎回的数额限制
投资者申购、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，本基金的最小申购、赎回单位为100万份。
基金管理人可根据基金运作情况、市场变化以及投资者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、本基金份额净值的计算，保留到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入，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，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。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。
2、申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的现金替代、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者申购、赎回的基金份额数额确定。
3、投资者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、赎回单位所对应的组合证券内各成份证券数据、T日预估现金部分、T-1日现金差额、基金份额净值以及其他相关内容。
2、组合证券相关内容
组合证券是指本基金投资组合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，用于替代本基金组合证券中全部或部分证券的一定数量的现金。
（1）现金替代分为两种类型：退补现金替代（标志为“退补”）和必须现金替代（标志为“必须”）。
退补现金替代是指当投资者申购或赎回基金份额时，允许使用现金作为该成份证券的替代，基金管理人按照申购、赎回清单要求，代理投资者买入或卖出证券，并与投资者进行相应结算。
必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，基金管理人按照固定现金替代金额与投资者进行结算。
（2）退补现金替代
①适用情形：退补现金替代的证券是指基金管理人认为需要在投资者申购或赎回时代投资者买入或卖出的证券。
②申购现金替代保证金：对于退补现金替代的证券，申购现金替代保证金的计算公式为：
替代金额=替代证券数量×该证券T日预计开盘价×T-1日估值汇率
申购现金替代保证金＝替代金额×（1＋现金替代溢价比例）
收取溢价的原因是，基金管理人需要在收到申购确认信息后，在香港市场买入组合证券，结算成本与替代金额可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购、赎回清单中预先确定溢价率，并据此收取申购现金替代保证金。如果申购现金替代保证金高于购入该部分证券的实际结算成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的申购现金替代保证金低于基金购入该部分证券的实际结算成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。
③申购现金替代保证金的处理程序
对于确认成功的T日申购申请，T日内基金管理人根据申购规模进行组合证券的代理买入，通常情况下代理买入在T日接近收盘时点完成。T日日终，基金管理人根据所购入的被替代证券的实际单位购入成本（包括买入价格与相关费用）和未买入的被替代证券的T日收盘价（折算为人民币，折算汇率采用当天的估值汇率；T日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价；交易日无收盘价的，取最后成交价）计算被替代证券的单位结算成本，在此基础上根据替代证券数量和申购现金替代保证金确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。T日后的第2个工作日内，基金管理人将应退款或补款与相关申购赎回代理机构办理交收。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。
如遇港股通临时停市、港股通交易每日额度或总额度不足等特殊情况，组合证券的代理买入及结算价格可依次顺延至下一港股通交易日直至交易正常。如遇证券长期停牌、流动性不足等可能导致收盘价或最后成交价不公允的特殊情况，可参照证券的估值价格，对结算价格进行调整，如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好的维护持有人利益，该证券对应的现金替代款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理。在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。
④赎回替代金额的处理程序
对于确认成功的T日赎回申请，T日内，基金管理人根据赎回规模进行组合证券的代理卖出，通常情况下代理卖出在T日接近收盘时点完成。T日日终，基金管理人根据所卖出的被替代证券的实际单位卖出金额（扣除相关费用）和未卖出的被替代证券的T日收盘价（折算为人民币，折算汇率采用当天的估值汇率；被替代证券T日在证券交易所无交易的，取最近交易日的收盘价；交易日无收盘价的，取最后成交价）计算被替代证券的单位结算金额，在此基础上根据替代证券数量确定赎回替代金额。T日后的第2个港股通交收日后的第2个工作日内，基金管理人将应支付的赎回替代金额与相关申购赎回代理机构办理交收。若发生特殊情况，基金管理人可以对交收日期进行相应调整。
如遇港股通临时停市等特殊情况，组合证券的代理卖出及结算价格可依次顺延至下一港股通交易日直至交易正常。如遇证券长期停牌、流动性不足等可能导致收盘价或最后成交价不公允的特殊情况，可参照证券的估值价格，对结算价格进行调整，如果基金管理人认为该证券复牌后的价格可能存在较大波动，且可能对基金资产净值产生较大影响，为了更好的维护持有人利益，该证券对应的现金替代款的清算交收可在其复牌后按照实际交易成本办理。在此期间若该证券发生除息、送股（转增）、配股等重要权益变动，则进行相应调整。
⑤未来如港股通的交易、结算规则发生改变，或上海证券交易所、登记机构ETF申购赎回交易结算规则发生改变，或基金管理人与基金托管人之间的结算相关安排发生改变，基金管理人可对退补现金替代处理规则进行调整，并按规定公告。
（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；或法律法规限制投资的证券；或基金管理人出于保护基金份额持有人利益等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。
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T日预计开盘价并按照T-1日估值汇率换算或基金管理人认为合理的其他方法。
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成份证券的替代金额＋申购、赎回清单中退补现金替代成份证券的数量、T日预计开盘价以及T-1日估值汇率的乘积之和）
T日预资者申购、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	2014-10-10
基金名称	华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金
基金管理公司名称	华夏基金管理有限公司
一级市场基金代码	513661

2014-10-09信息内容

最小申购、赎回单位的现金差额(单位;元)	64,732.18
最小申购、赎回单位资产净值(单位;元)	2,184,039.70
基金份额净值(单位;元)	2.1840

2014-10-10信息内容

最小申购、赎回单位的预估现金部分(单位;元)	66,101.11
现金替代比例上限	100%
是否需要公布IOPV	是
最小申购、赎回单位(单位;份)	1,000,000
申购的允许情况	是
赎回的允许情况	是
当日累计申购上限	5,000,000,000
当日累计赎回上限	无

成份股信息内容

股票代码	股票简称	股票数量	替代标志	溢价比例	替代金额（单位;人民币元）
00001	长江实业	552	退补	10%	63,705.24
00002	中电控股	667	退补	10%	37,500.21
00003	中华煤气	2229	退补	10%	34,117.93
00004	九龙仓	196	退补	10%	9,610.07
00005	汇丰控股	4828	退补	10%	335,829.05
00006	电能实业	572	退补	10%	35,300.22
00011	恒生银行	253	退补	10%	28,316.11
00012	恒基地产	626	退补	10%	28,128.79
00013	和记黄埔	627	退补	10%	53,806.08
00016	新鸿基	686	退补	10%	67,748.88
00017	新世界	1387	退补	10%	11,292.02
00019	太古股份	226	退补	10%	19,738.96
00023	东亚银行	480	退补	10%	13,200.45
00027	银河娱乐	708	退补	10%	29,560.85
00066	港铁公司	525	退补	10%	14,163.42
00083	信和置业	597	退补	10%	6,483.96
00101	恒隆地产	535	退补	10%	10,819.07
00135	昆仑能源	598	退补	10%	5,765.07
00144	招商局	465	退补	10%	9,606.15
00151	旺旺控股	3124	退补	10%	27,149.03
00267	中信股份	1	必须	0	10.76
00291	华润创业	595	退补	10%	9,843.77
00293	国泰航空	566	退补	10%	7,203.07
00322	康师傅	803	退补	10%	14,418.86
00386	中石化	7968	退补	10%	47,089.83
00388	港交所	371	退补	10%	56,204.59
00494	利丰	2141	退补	10%	16,814.72
00688	中国海外	1346	退补	10%	24,990.38
00700	腾讯控股	2298	退补	10%	236,163.05
00762	中国联通	1249	退补	10%	12,737.86
00836	华润电力	664	退补	10%	12,501.73
00857	中国石油	7133	退补	10%	61,740.42
00883	中海洋	6368	退补	10%	74,713.01
00939	建设银行	29488	退补	10%	143,425.92
00941	中国移动	2154	退补	10%	178,274.32
00992	联想集团	3341	退补	10%	34,597.21
01044	恒安国际	156	退补	10%	10,599.58
01088	中国神华	1189	退补	10%	22,334.55
01109	华润置地	817	退补	10%	12,491.07
01199	中远	842	退补	10%	7,691.68
01299	友邦保险	3742	退补	10%	138,135.5
01398	工商银行	22349	退补	10%	96,819.45
01880	百丽	1446	退补	10%	11,532.87
01928	金沙中国	866	退补	10%	32,194.75
02318	中国平安	741	退补	10%	38,689.5
02319	蒙牛乳业	484	退补	10%	14,175.32
02388	中银香港	1234	退补	10%	26,675.65
02628	中国人寿	2504	退补	10%	47,799.85
03328	交通银行	2542	退补	10%	12,253.18
03988	中国银行	27874	退补	10%	85,767.37

（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、上海证/和香港市场临时停市或者港股通临时停市。
3、因上海证券交易所证/和香港交易所假期休市等原因造成的可能影响基金正常运作的情况。
4、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收投资人的申购申请。
5、相关证券交易所、登记机构、申购赎回代理机构等因异常情况无法办理申购业务。
6、基金管理人开市前因异常情况未能公布申购赎回清单。
7、因异常情况导致申购赎回清单无法编制或编制不当，或基金份额参考净值（IOPV计算错误）。
8、港股通交易每日额度或总额度不足。
9、基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时。
10、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，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
11、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
12、法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。
发生上述第1-10项暂停申购情形，且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当及时公告。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投资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、上海证/和香港市场临时停市或者港股通临时停市。
3、因上海证券交易所证/和香港交易所假期休市等原因造成的可能影响基金正常运作的情况。
4、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收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。
5、相关证券交易所、登记机构、申购赎回代理机构等因异常情况无法办理赎回业务。
6、基金管理人开市前因异常情况未能公布申购赎回清单。
7、因异常情况导致申购赎回清单无法编制或编制不当，或基金份额参考净值（IOPV计算错误）。
8、基金所投资的投资品种的估值出现重大转变时。
9、法律法规、上海证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。
发生上述情形，且基金管理人决定暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应及时公告。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公告。

（十）其他申购赎回方式
1、基金管理人可以在不违反法律法规规定且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，调整基金申购赎回方式（如增加场外申赎）或申购赎回对价组成（如增加实物申赎），并提前公告。
2、ETF联接基金是指将其绝大部分基金财产投资于跟踪同一标的指数的ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金。若本基金推出联接基金，联接基金可以用股票或现金特殊申购本基金基金份额，不收取申购费用。
3、在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资者集合其持有的组合证券，共同构成最小申购、赎回单位或其整数倍，进行申购。
4、基金管理人指定的代理机构可依据基金合同开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，报中国证监会备案并公告。

（十一）基金份额折算
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机构申请办理基金份额折算与变更登记。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。

（十二）基金份额的非交易过户等其他业务
基金登记机构可依据相关法律法规及其业务规则，受理基金份额的转托管、非交易过户、质押、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

（十三）基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

十、基金的投资

（一）投资目标
紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（二）标的指数
本基金的标的指数为恒生指数。
如果指数发布机构变更或停止恒生指数的编制及发布、或恒生指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致恒生指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。

（三）投资范围
基金主要投资于跟踪标的指数的成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于全球市场的债券、基金、金融衍生工具（包括远期合约、互换、期货、期权、权证等）、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的80%。
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种