

（上接A22版）

第一部分 基金份额折算与变更登记

基金合同生效后,为提高交易便利,本基金可以进行份额折算。

- 基金份额折算的时间
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。
- 基金份额折算的原则
基金份额折算由基金管理人向登记结算机构申请办理,并由登记结算机构进行基金份额的变更登记。基金份额折算后,本基金的基本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与基金份额比例不发生变化。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其折算后的基金份额享有权利并承担义务。如果基金份额折算过程中发生不可抗力或登记结算机构故障等特殊情况无法进行,基金管理人可延迟处理基金份额折算。
- 基金份额折算的方法
基金份额折算的具体方法在基金份额折算公告中所列示。

第九部分 基金份额的上市交易

- 《基金合同》生效后,具备下列条件的,基金管理人可依据《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》,向深圳证券交易所申请基金份额上市:
 - 基金募集金额(含网下股票认购所募集的股票市值)不低于2亿元人民币;
 - 基金份额持有人不少于1,000人;
 - 《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其它条件。基金上市前,基金管理人应与深圳证券交易所签订上市协议书。基金份额获准在深圳证券交易所上市的,基金管理人应在基金获准上市后的3个工作日内发布基金份额上市公告书、基金份额上市交易公告书。
- 基金份额的上市
基金获准在深圳交易所的上市交易,将导致终止上市交易,应遵照《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、《深圳证券交易所证券投资基金开放式指数基金业务实施细则》等有相关规定。
- 暂停上市交易
基金上市交易期间出现下列情形之一,深圳证券交易所可暂停基金的上市交易,并报中国证监会备案:
 - 不再具备《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的上市条件;
 - 违反法律、行政法规,中国证监会决定暂停其上市;
 - 严重违反深圳证券交易所有关规定;
 - 深圳证券交易所认为应当暂停其上市的其他情形。当暂停上市情形消除后,基金管理人可向深圳证券交易所申请恢复恢复上市申请,经深圳证券交易所核准后可恢复基金上市,并在至少一个规定规模发布基金恢复上市公告。
- 终止上市交易
基金份额终止上市交易后,有下列情形之一,深圳证券交易所可终止基金的上市交易,并报中国证监会备案:
 - 自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因;
 - 基金合同终止;
 - 基金份额持有人大会决议终止上市;
 - 基金合同约定的终止上市的其他情形;
 - 深圳证券交易所认为应当终止上市的其他情形。基金管理人应当在收到深圳证券交易所终止基金上市的通知之日起2个工作日内发布基金终止上市公告。

- 若因上述1、3、4.5 等原因致使本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的,本基金将有权在当期例行止上市时采用开放式基金净值变更为以中证全指信息技术指数为标的指数的指数基金。若届时本基金管理人已有该指数作为标的指数的指数基金,基金管理人将本着维护基金份额持有人合法权益的原则,选取其他合适的指数作为标的指数,报中国证监会备案并及时公告。
- 基金份额折算净值计算与委托
基金管理人或者基金管理人委托中证指数有限公司在相关证券交易所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折算参考净值(IOPV)并由深圳证券交易所交易日内发布,供投资人查阅,申购、赎回按照基金份额参考净值进行。
- 基金份额折算的计算公式
基金份额折算净值=（申购赎回清单中必须用现金替代的替代金额+申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的现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现量与最新成交价相乘之和+1.申购赎回清单中的预估现金差额）/最小申购赎回单位对应的基金份额。
- 基金份额折算净值的计算以四舍五入的方法保留小数点后3位。
- 基金管理人可以调整基金份额折算净值计算公式,并予以公告。
- 在不违反法律法规且不损害基金份额持有人利益的前提下,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,而无须召开持有人会议。

- 申购、赎回的场所
基金投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回,并予以公告。
 - 申购赎回的开放时间
1.开放日及开放时间
投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回,具体办理时间为上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。
基金合同生效后,若出现新的证券交易所、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前开放日及开放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介公告。
 - 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。
- 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。
在申购赎回开始与申购开始时间,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。

- 申购、赎回的原则
1.申购、赎回应遵守《深交所:《业务规则》和《登记结算业务实施细则》及其他相关规定。
2.本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。
3.本基金的申购价、赎回价均包括申购费、赎回费、现金替代、现金差额及其他对价。
4.申购、赎回申请提交后不得撤销。
基金管理人可在法律法规允许的情况下,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。
 - 申购、赎回的申购方式
投资人必须根据申购赎回代理券商或基金管理人规定的程序,在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。
 - 投资人在提交申购申请时按申购赎回清单每笔申购对价,投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额作为质押,否则赎回申请无效。
 - 申购和赎回申请的确认
基金投资者申购、赎回申请在T+1日进行确认。对于投资人提交的申购申请,申购赎回代理券商根据投资人提交的申购申请并在T日基金管理人公布的申购赎回清单,相应冻结投资人账户内的组合证券、现金替代和预估现金差额,T+1日,基金管理人对该经确认符合要求的申购申请予以确认。如申购情况不符合要求,则申购申请失败。对于投资人提交的赎回申请,申购赎回代理券商根据投资人提交的赎回申请以及T日基金管理人公布的申购赎回清单,相应冻结投资人账户内的基金份额、预估现金差额,T+1日,基金管理人根据冻结情况对投资人的赎回申请予以确认。如投资人申购或赎回申请的基金份额不足或未能提供足额准备的现金、或基金投资组合内不具备足够的符合要求的赎回对价,则赎回申请失败。
 - 投资人可在T+2日通过其办理申购、赎回的销售网点查询有关申请的确认情况。投资人应及时查看有关申请的确认情况。
- 申购和赎回的费用及登记
1.本基金申购赎回过程中涉及的组合证券和基金份额交收适用中国证券登记结算有限责任公司及相关证券交易所最新的相关规定。
T+1日,登记结算机构根据基金管理人申购、赎回申请的确认信息,为投资者办理组合证券、基金份额的清算交收,并结算相关费用至投资者证券账户,申购赎回款项由基金管理人、基金托管人、通常情况下的投资者按T日申购所得的基金份额、赎回所得的组合证券在T+2日可用。现金替代和现金差额由基金管理人于申购赎回代理券商于T+1日进行清算,T+2日进行交收,登记结算机构可以依据相关规则对此提供代收代付服务并完成交收。对于确认失败的申请,登记结算机构将对冻结的组合证券和基金份额予以解冻,申购赎回代理券商将对冻结的资金予以解冻。

- 如果登记结算机构在清算交收过程中发生清算交收参与方不能正常履约的情况,则依据《登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。
投资人在依据本基金合同约定的定期赎回时足额支付应付的现金差额、现金替代和现金替代补款。因投资人原因导致现金差额、现金替代和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人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。若投资人用以申购的部分或全部组合证券或者用以赎回的部分或全部基金份额因被国家有权机关冻结或强制执行导致不足额的,基金管理人有权指示申购赎回代理券商及登记结算机构依法进行相应处理;如该等情况导致其他基金份额持有人或基金资产遭受损失的,基金管理人有权代表其他基金份额持有人或基金资产要求该投资者予以赔偿。
4.基金管理人不承担基金份额持有人权益,并不涉及境外和登记结算机构相关规则的情况下可更改上述程序。基金管理人应遵守新规则开始日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。
- 申购、赎回的数额限制
1.投资人申购、赎回的基金份额须为最小申购赎回单位的整数倍,本基金最小申购赎回单位为2,000,000份。
2.基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述规定的数量或比例限制。基金管理人必须在调整前依照《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。

- 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。申购对价是指投资者申购基金份额时应支付的对价组合,包括现金替代、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对价组合,包括现金替代、现金差额及其他对价。
2.申购赎回清单由基金管理人编制,T日的申购赎回清单在当日深圳证券交易所开市前通过深圳证券交易所及登记结算机构,并在深圳证券交易所及基金管理人网站公布,T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日公布,计算公式为当日基金份额资产净值除以T日计算日基金份额总额,保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入。如经事先约定,可对上述基金份额净值采取四舍五入的方式进行处理。
- 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,其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。
- 申购、赎回清单的内容
T日申购赎回清单中内容应包括但不限于最小申购赎回单位对应的组合证券内容、基金替代标志、预估现金差额、T日最小申购赎回单位比例上限、T日预估现金差额、T-1日现金差额、T-1日基金份额净值及其他相关申购、赎回费用。
- 组合证券相关内容
组合证券是指本基金标的指数的成份所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购、赎回单位对应的组合证券名称、证券代码及数量。

- 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。
采用现金替代是为了在相关成份证券停牌情况下便利投资者申购、赎回提高基金运作效率,基金管理人不得因现金的现金替代方法对追缴公平及公开的原则,以保护基金份额持有人利益为出发点,并进行及时充分的信息披露。
（1）现金替代分为三种类型:禁止类现金替代(标志为“禁止”),可以现金替代(标志为“允许”)和必须现金替代(标志为“必须”)。
可以现金替代是指申购、赎回基金份额时,该成份证券不允许使用现金作为替代。
必须现金替代是指申购、赎回基金份额时,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,该成份证券必须使用现金作为替代。
- 必须现金替代
（1）可以现金替代
①适用情形:在通过“可以现金替代比例上限”来控制以现金替代比例的前提下,如无特殊说明,将除设置为“必须现金替代”和“禁止现金替代”情形以外的全部设置为“可以现金替代”。采用可以现金替代时,应充分揭示由此产生的市场套利行为对基金份额持有人可能造成的不利影响。
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×该证券最近调整前T-1日收盘价×（1+现金替代保证金率）
对于采用现金替代的证券,基金管理人应在证券恢复交易后,而实际买入相关证券交易费用后与申购的最新价格可有所差异。为了方便操作,基金管理人于申购赎回清单中预先确定现金替代保证金率,并据此收取替代金额。如果现金替代的金额高于基金买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买入该部分证券的实际成本,则基金管理人将向投资人收取欠缺的差额。
③替代金额的处理程序
T日,基金管理人应在申购赎回清单公布现金替代保证金率,并在T+2日收取替代金额。
在T+1日后赎回的成份证券有正常交易的2个交易日(简称为T+3日)内,基金管理人将以收到的替代金额买入T被替代的部分证券。
T+3日终,若买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,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项;若未能买入全部被替代的证券,则以替代金额与被买入的替代证券实际购入成本(包括T+3日收盘价计算的买入价格)的差额确定被替代证券价值的差额,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项。
特别情形:若T+1日终,相关证券正常交易且T+1日收盘价已低于当日而该证券正常交易又低于T+2日,则以替代金额与被买入的替代证券实际购入成本加上T+2日收盘价一次收盘价计算的买入价格与买入的的部分被替代证券价值的差额,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项。

- T+3日后第一个工作日(若在前例情况下,则为T+1日起第21个交易日),基金管理人将应退还和补款的部分按照赎回、申购和赎回代理券商和基金托管人、现金替代部分证券的清算和交收在T+3日后2个工作日内(若在前例情况下,则为T+1日起第22个交易日)内完成,登记结算机构将对提供代收代付服务。
特别限制:为有效控制现金替代的跟踪误差和跟踪误差,基金管理人可规定投资人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:

- 基金管理人应在申购赎回清单中公布现金替代保证金率,并在T+2日收取替代金额。
在T+1日后赎回的成份证券有正常交易的2个交易日(简称为T+3日)内,基金管理人将以收到的替代金额买入T被替代的部分证券。
- T+3日终,若买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,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项;若未能买入全部被替代的证券,则以替代金额与被买入的替代证券实际购入成本(包括T+3日收盘价计算的买入价格)的差额确定被替代证券价值的差额,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项。
- 特别情形:若T+1日终,相关证券正常交易且T+1日收盘价已低于当日而该证券正常交易又低于T+2日,则以替代金额与被买入的替代证券实际购入成本加上T+2日收盘价一次收盘价计算的买入价格与买入的的部分被替代证券价值的差额,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项。

- T+3日后第一个工作日(若在前例情况下,则为T+1日起第21个交易日),基金管理人将应退还和补款的部分按照赎回、申购和赎回代理券商和基金托管人、现金替代部分证券的清算和交收在T+3日后2个工作日内(若在前例情况下,则为T+1日起第22个交易日)内完成,登记结算机构将对提供代收代付服务。
特别限制:为有效控制现金替代的跟踪误差和跟踪误差,基金管理人可规定投资人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:
- 基金管理人应在申购赎回清单中公布现金替代保证金率,并在T+2日收取替代金额。
在T+1日后赎回的成份证券有正常交易的2个交易日(简称为T+3日)内,基金管理人将以收到的替代金额买入T被替代的部分证券。
- T+3日终,若买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,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项;若未能买入全部被替代的证券,则以替代金额与被买入的替代证券实际购入成本(包括T+3日收盘价计算的买入价格)的差额确定被替代证券价值的差额,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项。
- 特别情形:若T+1日终,相关证券正常交易且T+1日收盘价已低于当日而该证券正常交易又低于T+2日,则以替代金额与被买入的替代证券实际购入成本加上T+2日收盘价一次收盘价计算的买入价格与买入的的部分被替代证券价值的差额,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项。

- 基金管理人应在申购赎回清单中公布现金替代保证金率,并在T+2日收取替代金额。
在T+1日后赎回的成份证券有正常交易的2个交易日(简称为T+3日)内,基金管理人将以收到的替代金额买入T被替代的部分证券。
- T+3日终,若买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,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项;若未能买入全部被替代的证券,则以替代金额与被买入的替代证券实际购入成本(包括T+3日收盘价计算的买入价格)的差额确定被替代证券价值的差额,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项。
- 特别情形:若T+1日终,相关证券正常交易且T+1日收盘价已低于当日而该证券正常交易又低于T+2日,则以替代金额与被买入的替代证券实际购入成本加上T+2日收盘价一次收盘价计算的买入价格与买入的的部分被替代证券价值的差额,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项。
- T+3日后第一个工作日(若在前例情况下,则为T+1日起第21个交易日),基金管理人将应退还和补款的部分按照赎回、申购和赎回代理券商和基金托管人、现金替代部分证券的清算和交收在T+3日后2个工作日内(若在前例情况下,则为T+1日起第22个交易日)内完成,登记结算机构将对提供代收代付服务。
特别限制:为有效控制现金替代的跟踪误差和跟踪误差,基金管理人可规定投资人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:

- 基金管理人应在申购赎回清单中公布现金替代保证金率,并在T+2日收取替代金额。
在T+1日后赎回的成份证券有正常交易的2个交易日(简称为T+3日)内,基金管理人将以收到的替代金额买入T被替代的部分证券。
- T+3日终,若买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,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项;若未能买入全部被替代的证券,则以替代金额与被买入的替代证券实际购入成本(包括T+3日收盘价计算的买入价格)的差额确定被替代证券价值的差额,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项。
- 特别情形:若T+1日终,相关证券正常交易且T+1日收盘价已低于当日而该证券正常交易又低于T+2日,则以替代金额与被买入的替代证券实际购入成本加上T+2日收盘价一次收盘价计算的买入价格与买入的的部分被替代证券价值的差额,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项。
- T+3日后第一个工作日(若在前例情况下,则为T+1日起第21个交易日),基金管理人将应退还和补款的部分按照赎回、申购和赎回代理券商和基金托管人、现金替代部分证券的清算和交收在T+3日后2个工作日内(若在前例情况下,则为T+1日起第22个交易日)内完成,登记结算机构将对提供代收代付服务。
特别限制:为有效控制现金替代的跟踪误差和跟踪误差,基金管理人可规定投资人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:

- 基金管理人应在申购赎回清单中公布现金替代保证金率,并在T+2日收取替代金额。
在T+1日后赎回的成份证券有正常交易的2个交易日(简称为T+3日)内,基金管理人将以收到的替代金额买入T被替代的部分证券。
- T+3日终,若买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,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项;若未能买入全部被替代的证券,则以替代金额与被买入的替代证券实际购入成本(包括T+3日收盘价计算的买入价格)的差额确定被替代证券价值的差额,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项。
- 特别情形:若T+1日终,相关证券正常交易且T+1日收盘价已低于当日而该证券正常交易又低于T+2日,则以替代金额与被买入的替代证券实际购入成本加上T+2日收盘价一次收盘价计算的买入价格与买入的的部分被替代证券价值的差额,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项。
- T+3日后第一个工作日(若在前例情况下,则为T+1日起第21个交易日),基金管理人将应退还和补款的部分按照赎回、申购和赎回代理券商和基金托管人、现金替代部分证券的清算和交收在T+3日后2个工作日内(若在前例情况下,则为T+1日起第22个交易日)内完成,登记结算机构将对提供代收代付服务。
特别限制:为有效控制现金替代的跟踪误差和跟踪误差,基金管理人可规定投资人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:

- 基金管理人应在申购赎回清单中公布现金替代保证金率,并在T+2日收取替代金额。
在T+1日后赎回的成份证券有正常交易的2个交易日(简称为T+3日)内,基金管理人将以收到的替代金额买入T被替代的部分证券。
- T+3日终,若买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,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项;若未能买入全部被替代的证券,则以替代金额与被买入的替代证券实际购入成本(包括T+3日收盘价计算的买入价格)的差额确定被替代证券价值的差额,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项。
- 特别情形:若T+1日终,相关证券正常交易且T+1日收盘价已低于当日而该证券正常交易又低于T+2日,则以替代金额与被买入的替代证券实际购入成本加上T+2日收盘价一次收盘价计算的买入价格与买入的的部分被替代证券价值的差额,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项。
- T+3日后第一个工作日(若在前例情况下,则为T+1日起第21个交易日),基金管理人将应退还和补款的部分按照赎回、申购和赎回代理券商和基金托管人、现金替代部分证券的清算和交收在T+3日后2个工作日内(若在前例情况下,则为T+1日起第22个交易日)内完成,登记结算机构将对提供代收代付服务。
特别限制:为有效控制现金替代的跟踪误差和跟踪误差,基金管理人可规定投资人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:

- 基金管理人应在申购赎回清单中公布现金替代保证金率,并在T+2日收取替代金额。
在T+1日后赎回的成份证券有正常交易的2个交易日(简称为T+3日)内,基金管理人将以收到的替代金额买入T被替代的部分证券。
- T+3日终,若买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,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项;若未能买入全部被替代的证券,则以替代金额与被买入的替代证券实际购入成本(包括T+3日收盘价计算的买入价格)的差额确定被替代证券价值的差额,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项。
- 特别情形:若T+1日终,相关证券正常交易且T+1日收盘价已低于当日而该证券正常交易又低于T+2日,则以替代金额与被买入的替代证券实际购入成本加上T+2日收盘价一次收盘价计算的买入价格与买入的的部分被替代证券价值的差额,确定基金资产退还投资者或投资者应支付的款项。
- T+3日后第一个工作日(若在前例情况下,则为T+1日起第21个交易日),基金管理人将应退还和补款的部分按照赎回、申购和赎回代理券商和基金托管人、现金替代部分证券的清算和交收在T+3日后2个工作日内(若在前例情况下,则为T+1日起第22个交易日)内完成,登记结算机构将对提供代收代付服务。
特别限制:为有效控制现金替代的跟踪误差和跟踪误差,基金管理人可规定投资人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:

- 预估现金差额的计算公式为:
T日预估现金差额=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用现金替代的固定替代金额+申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日经除权调整后的开盘参考价相乘之和+1.申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日经除权调整后的开盘参考价相乘之和）
其中,T日经除权调整的开盘参考价主要根据中证指数公司所提供的标的指数的成份证券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”需扣除相应成分证券的分红影响,预估现金差额数据可能为正,为负或为零。
- 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-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用现金替代的固定替代金额+申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和+1.申购赎回清单中禁止用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。
现金差额的数据可能为正,为负或为零。在投资人申购时,如现金差额为正数,则投资人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,则投资人将根据其申购的基金份额获得相应的现金;在投资人赎回时,如现金差额为正数,则投资人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,则投资人应依据其赎回的基金份额支付相应的现金。

- 申购、赎回清单的格式
基金管理人有权根据业务需要对申购、赎回清单的格式进行修改。
申购、赎回清单的格式举例如下:
基本信息

基金名称:	广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金
基金管理人名称:	广发基金管理有限公司
基金代码:	300035
标的指数代码:	000093

最新公告日期:

20141204

基金名称:

广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金

基金管理人名称:

广发基金管理有限公司

基金代码:

300035

标的指数代码:

000093

- T-1日 信息内容

现金差额(单位:元):	0
最小申购、赎回单位资产净值(单位:元):	2000000
基金份额净值(单位:元):	1.0000
预估现金差额(单位:元):	-78016
可以现金替代比例上限:	40.000%
是否需要公布IOPV:	是
最小申购、赎回单位(单位:份):	2000000
最小申购赎回单位现金红利(单位:元):	0
申购赎回组合证券只数:	247
是否开放申购:	是
是否开放赎回:	是
是否开放保证申购:	否

组合证券内容

证券代码	证券简称	股票数量	现金替代标志	现金替代保证金率	固定替代金额
300052	中晋宝	100	允许	21.00%	
300053	股比托	100	允许	21.00%	
300059	东方财富	700	允许	21.00%	
002214	大立科技	100	允许	21.00%	
002218	拓荆科技	200	允许	21.00%	
002230	科思飞	400	允许	21.00%	
002232	御银信息	200	允许	21.00%	
002236	大智软件	200	允许	21.00%	
002241	欧陆电子	600	允许	21.00%	
002253	川智光电	100	允许	21.00%	
002261	拓维信息	200	允许	21.00%	
002268	卫宁卫生	100	允许	21.00%	
002273	水晶光电	200	允许	21.00%	
002279	久其软件	100	允许	21.00%	
002288	超华科技	200	允许	21.00%	
002308	威胜股份	300	允许	21.00%	
002309	中利科技	200	允许	21.00%	
002312	三能电子	200	允许	21.00%	
002315	焦点光电	100	允许	21.00%	
002331	能通科技	100	允许	21.00%	
002344	科能光电	100	允许	21.00%	
002368	大晟股份	100	允许	21.00%	
002371	七里光电	100	允许	21.00%	
002376	新北洋	200	允许	21.00%	
002390	南洋转债	100	允许	21.00%	
002401	中科中技	100	允许	21.00%	
002402	和而泰	100	允许	21.00%	
002405	四维图新	400	允许	21.00%	
002410	广联达	300	允许	21.00%	
002414	高德红外	200	允许	21.00%	
002415	海康威视	900	允许	21.00%	
002421	达实智能	100	允许	21.00%	
002436	兴森科技	100	允许	21.00%	
002439	启明光电	200	允许	21.00%	
002449	国星光电	200	允许	21.00%	
002456	欧陆光电	500	允许	21.00%	
002474	聚龙软件	200	允许	21.00%	
002475	汇金转债	200	允许	21.00%	
002484	江通股份	100	允许	21.00%	
002512	迪华智能	100	允许	21.00%	
002528	英飞特	100	允许	21.00%	
002544	中电信息	200	允许	21.00%	
002577	雷科智能	100	允许	21.00%	
002590	中电信息	200	允许	21.00%	
002609	广信材料	100	允许	21.00%	
002609	捷顺科技	100	允许	21.00%	
002635	安道科技	100	允许	21.00%	
002636	金安国纪	100	允许	21.00%	
002638	鹏上光电	100	允许	21.00%	
002642	安之星	100	允许	21.00%	
002649	博彦科技	100	允许	21.00%	
002654	万润科技	100	允许	21.00%	
002655	共达电声	100	允许	21.00%	
002657	同国通信	100	允许	21.00%	
002658	雪龙海	100	允许	21.00%	
002660	茂源光电	100	允许	21.00%	
002690	美亚光电	100	允许	21.00%	
300002	科华数据	500	允许	21.00%	
300010	立思辰	100	允许	21.00%	
300014	亿华智能	200	允许	21.00%	
300017	网科科技	100	允许	21.00%	
300020	盟信股份	100	允许	21.00%	
300025	华星创业	100	允许	21.00%	
300028	金宇科技	200	允许	21.00%	
300032	金龙电机	100	允许	21.00%	
300033	同力科技	100	允许	21.00%	
300036	超图软件	100	允许	21.00%	
300044	普安智能	100	允许	21.00%	
300047	网达通信	100	允许	21.00%	
300050	世纪联创	100	允许	21.00%	
300051	三五互联	100	允许	21.00%	
300068	南都电源	300	允许	21.00%	
300075	数字政通	100	允许	21.00%	
300076	QY视讯	100	允许	21.00%	
300077	国民技术	200	允许	21.00%	
300078	康恩股份	200	允许	21.00%	
300085	长电科技	200	允许	21.00%	
300096	聚龙众	300	允许	21.00%	
300099	尤卓尔	100	允许	21.00%	
300102	乾照光电	100	允许	21.00%	
300104	乐网科技	300	允许	21.00%	
300111	同创互联	700	允许	21.00%	
300113	顺网科技	100	允许	21.00%	
300114	长电精密	100	允许	21.00%	
300115	长讯光电	200	允许		