（上接A09版）

传真：021－63350003
经办注册会计师：郭新华、洪锐明

第六部分 基金的募集

基金管理人按照《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，并于2013年9月29日经中国证监会证监许可[2013]1262号文注册募集。

一、基金运作方式
交易型开放式。
二、基金类型
股票型证券投资基金。
三、基金存续期限
不定期。
四、募集期限及募集对象
募集期限自基金份额发售之日起最长不得超过3个月，具体发售时间见基金份额发售公告。
本基金募集对象为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、合格境外机构投资者、人民币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。
五、募集规模
本基金最低募集规模为2亿份基金份额，基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不少于2亿元人民币。本基金不设首次募集目标上限。
六、发售方式
投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式。
网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构利用深圳证券交易所网上系统以现金进行认购。
网下现金认购是指投资人通过基金管理人以现金进行认购。
网下股票认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票进行认购。
基金投资者在募集期内可多次认购，认购一经受理不得撤销。
销售机构认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表发售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记结算机构的确认结果为准。
七、募集场所
投资人应当在基金管理人及其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所，或者按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。
基金管理人、发售代理机构办理基金发售业务的具体情况和联系方式，请参见基金份额发售公告。
基金管理人可以根据情况增加其他发售代理机构，并另行公告。
八、基金份额发售面值和认购价格
本基金基金份额发售面值为人民币1.00元，认购价格为1.00元。
九、认购开户
1、投资人认购本基金时需具有深圳证券交易所A 股账户（以下简称“深圳A 股账户”）或深圳证券交易所证券投资基金账户（以下简称“深圳证券投资基金账户”）。
（1）已有深圳A 股账户或深圳证券投资基金账户的投资人不必再办理开户手续。
（2）尚无深圳A 股账户或深圳证券投资基金账户的投资者人，需在认购前持本人身份证到中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构办理深圳A 股账户或深圳证券投资基金账户的开户手续。有关开设深圳A 股账户和深圳证券投资基金账户的具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询有关规定。
2、账户使用注意事项
（1）如投资人需要参与网下现金或网上现金认购，应使用深圳A 股账户或深圳证券投资基金账户；深圳证券投资基金账户只能进行本基金的现金认购和二级市场交易。
（2）如投资人以深圳证券交易所上市交易的本基金成份股或备选成份股进行网下股票认购的，应开立并使用深圳A 股账户。
（3）如投资人以上海证券交易所股票进行网下股票认购的，除了持有深圳A 股账户或深圳证券投资基金账户外，还应持有上海证券交易所A 股账户（以下简称“上海A 股账户”），且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有，并注意投资人认购基金份额的托管证券公司和上海A 股账户指定交易证券公司应为同一发售代理机构。
（4）如投资人需要通过申购赎回代理券商参与本基金的申购、赎回，应同时持有并使用深圳A 股账户与上海A 股账户，且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有，并注意投资人用以申购、赎回的深圳证券交易所股票的托管证券公司和上海A 股账户的指定交易证券公司应为同一申购赎回代理券商，否则无法办理本基金的申购和赎回。
（5）已通过二级市场购买广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）、广发中小板300交易型开放式指数基金、广发聚利债券型证券投资基金（LOF）、广发深证100指数分级证券投资基金分级份额（包含广发深证100A份额及广发深证100B份额）、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数基金的投资人，其所持有的深圳A 股账户或证券投资基金账户可用于认购本基金。
（6）已购买过由广发基金管理有限公司担任注册登记机构的基金的投资人，其所持有的广发基金管理有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。
十、认购费用
认购费用由投资人承担，不高于0.80%，认购费率如下表所示：

认购份额	认购费率
M< 50万份	0.80%
50万份≤M< 100万份	0.50%
M≥100万份	1000元/笔

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。
十一、网上现金认购
1、认购时间：详见基金份额发售公告。
2、认购限额：网上现金认购以基金份额申请。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。投资人可以多次认购，累计认购份额不设上限。
3、认购申请：投资人在认购本基金时，需按发售代理机构的规定备足认购资金，办理认购手续。
4、认购金额和利息折算的份额的计算
本基金认购金额的计算如下：
认购佣金=认购份格×认购份额×佣金比率
净认购金额＝认购份格×认购份额
认购金额＝认购佣金+净认购金额
网上现金认购款项在基金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。网上现金认购的利息和具体份额以登记结算机构的记录为准。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。
利息折算的份额＝利息/认购份格
例：某投资者到某发售代理机构网点认购100,000份本基金基金份额，假设该发售代理机构确认的佣金比例为0.80%，则需准备的资金金额计算如下：
认购佣金=1.00×100,000×0.80%=800元
净认购金额=1.00×100,000=100,000元
认购金额=800+100,000=100,800元
即投资者需要准备100,800元资金，方可认购到100,000份本基金基金份额。假定该笔认购金额产生利息10元，则投资者可得到100,010份本基金基金份额。
十二、网下现金认购
1、认购时间：详见基金份额发售公告。
2、认购限额：网下现金认购以基金份额申请。投资人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）。投资人可以多次认购，累计认购份额不设上限。
3、认购手续：投资人在认购本基金时，需按基金管理人的规定办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后不得撤销。
4、认购金额和利息折算的份额的计算
认购以基金份额申请，认购费用、认购金额的计算公式为：
认购费用＝认购份格×认购份额×认购费率
认购金额＝认购份格×认购份额×（1＋认购费率）
净认购份额＝认购份额＋认购金额产生的利息/基金份额发售面值
网下现金认购款项在基金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，网下现金认购款项利息数额以基金管理人的记录为准。利息折算的份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。
利息折算的份额＝利息/认购份格
例：某投资者在本公司直销网点认购100,000份本基金基金份额，假定认购金额产生的利息为10元，则需准备的资金金额的计算如下：
认购费用=1.00×100,000×0.80%=800元
认购金额=1.00×100,000×（1+0.80%）=100,800元
净认购份额=100,000+10/1.00=100,010份
即该投资者若通过基金管理人认购本基金100,000份，则需准备100,800元资金，假定该笔认购金额产生利息10元，则投资者可得到100,010份本基金基金份额。
5、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＋1日进行有效认购款项的清算交收，将认购资金划入基金管理人预先开设的基金募集专户。
十三、网下股票认购
1、认购时间详见本基金基金份额发售公告，具体业务办理时间由指定发售代理机构确定。
2、认购限额：网下股票认购以单只股票股数申报，用以认购的股票必须是中证全指金融地产指数成份股和已公告的备选成份股（具体名单以发售公告为准）。单只股票最低认购申报股数为1000股，超过1000股的部分须为100股的整数倍。投资人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：投资人在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，到发售代理机构网点办理认购手续，并备足认购股票。网下股票认购申请提交后不得撤销，发售代理机构对投资人申报的股票进行冻结。投资人的认购股票在网下股票认购日至登记结算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者所有。
4、特殊情形
（1）已公告的将被调出中证全指金融地产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。
5、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人证券账户汇总发送给基金管理人，基金管理人收到股票认购数据后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，冻结上海市场网下认购股票，并将投资人深圳市场网下认购股票过户至本基金组合证券认购专户。基金管理人为投资人计算认购份额，并根据发售代理机构提供的数据计算投资人应以基金份额方式支付的佣金，从投资人的认购份额中扣除，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，将上海和深圳的股票过户至本基金在上海、深圳开立的证券账户。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人净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记。
6、认购份额的计算公式：

[illegible]

其中：
（1）i代表投资人提交认购申请的第i只股票，n代表投资人提交的股票总只数。如投资者仅提交了1只股票的申请，则n＝1。
（2）T日为网下股票认购期最后一日。
（3）“第i只股票在T日的均价” 由基金管理人根据深圳证券交易所及上海证券交易所的T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T日停牌或无成交，则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。
若某一股票在T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，则由于投资人获得了相应的权益，基金管理人将按如下方式对该股票在T日的均价进行调整：
①除息：调整后价格＝T日均价－每股现金股利或股息
②送股：调整后价格＝T日均价（1＋每股送股比例）
③配股：调整后价格＝(T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＝(T日均价＋配股价(配股比例))/(1＋每股送股比例＋每股配股比例)
⑤除息且送股：调整后价格＝(T日均价－每股现金股利或股息)/(1＋每股送股比例)
⑥除息且配股：调整后价格＝(T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)
⑦除息、送股且配股：调整后价格＝(T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)
（4）“有效认购数量”是指由基金管理人确认的由登记结算机构完成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：

[illegible]

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，则根据认购日期的先后按照先到先得的方式确认。如同一天申报的个股认购数量全部确认将突破基金管理人可确认上限的，则按比例分配确认。
②对于未公告限制认购规模的个股，以本基金初始募集规模为基准，投资者提交认购申请的数量没有超过该个股在T日中证全指金融地产指数中的权重的，原则上可全部确认为有效认购数量；投资者提交认购申请的数量超过了该个股在T日中证全指金融地产指数中的权重的，对于超额部分，管理人原则上不再接受流动性受限的股票。
③若某一股票在网下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人的有效认购数量进行相应调整。
7、特别提示：投资人应根据法律法规及深圳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。
十四、募集资金利息与募集股票权益的处理方式
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，认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额，归投资人所有；投资人以股票认购的，认购股票由发售代理机构予以冻结，该股票自认购日至登记结算机构进行股票过户日的冻结期间所产生的权益归认购投资人本人所有。
十五、募集期间的资金、股票与费用
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。募集的股票由发售代理机构予以冻结。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。

第七部分 基金合同的生效

一、基金合同生效的条件
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（含网下股票认购所募集的股票市值）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，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。
二、基金募集失败
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，发售代理机构应予以解冻。
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，连续二十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5,000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十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，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。
法律法规另有规定的，从其规定。

第八部分 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。
一、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。
二、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。
如果基金份额折算过程中发生不可抗力或登记结算机构遇特殊情况无法办理，基金管理人可延迟办理基金份额折算。
三、基金份额折算的方法
基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

第九部分 基金份额的上市交易

一、基金份额的上市
《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：
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2亿元人民币；
2、基金份额持有人不少于1,000人；
3、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。
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份额上市日的3个工作日前发布基金份额上市交易公告书。
二、基金份额的交易
基金份额在深圳交易所的上市交易、暂停或终止上市交易，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》、《深圳证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则》等有关规定。
三、暂停上市交易
基金份额上市交易期间出现下列情形之一的，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：
1、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；
2、违反法律、行政法规，中国证监会决定暂停其上市；
3、严重违反深圳证券交易所有关规则的；
4、深圳证券交易所认为应当暂停上市的其他情形。
当暂停上市情形消除后，基金管理人可向深圳证券交易所提出恢复上市申请，经深圳证券交易所核准后可恢复本基金上市，并在至少一种指定媒介发布基金恢复上市公告。
四、终止上市交易
基金份额上市交易后，有下列情形之一的，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：
1、自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的；
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、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决定之日起2日内发布基金终止上市公告。
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深圳证券交易所终止上市的，本基金将在履行适当程序后由交易型开放式指数证券投资基金变更为以中证全指金融地产指数为标的指数的指数基金。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，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。
五、基金份额参考净值的计算与公告
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参考净值（IOPV）并由深圳证券交易所在交易时间内发布，供投资人交易、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差额）/最小申购赎回单位对应的基金份额。
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。
六、在不违反法律法规及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，而无需召开持有人大会审议。
七、如未来深圳证券交易所推出ETF的新业务，如分级ETF等，在不损害基金份额持有人利益的前提下，经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金将增设分级份额。基金管理人可就分级后的全部或部分份额申请上市。本基金基金合同相应予以修改，此项修改无需召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

第十部分 基金份额的申购与赎回

一、申购与赎回的场所
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。
基金管理人可根据情况变更或增减基金申购赎回代理券商，并予以公告。在相关条件许可的前提下，基金管理人可增加或调整申购赎回代理机构，并予以公告。
二、申购与赎回的开放日及时间
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市场、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介上公告。
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，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。
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2日依照《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、申购、赎回应遵守深交所《业务细则》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。
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。
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须按申购赎回清单备足申购对价，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和现金，否则所提交的申购、赎回申请无效。
2、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组合证券、现金替代款和预估现金差额。T+1日，基金管理人对冻结情况符合要求的申购申请予以确认。如冻结情况不符合要求，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，或本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。投资人应及时查询有关申请的确认情况。
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则。
T+1日，登记结算机构根据基金管理人对申购、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，并将结果发送给相关证券交易所、申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。通常情况下，投资者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与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时发生清算交收参与方不能正常履约的情形，则依据《登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。
投资者应按照本基金合同的约定和申购赎回代理券商的规定按时足额支付应付的现金差额、现金替代和现金替代退补款。因投资人原因导致现金差额、现金替代和现金替代退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置；如该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进行赔偿。
4、基金管理人在不损害基金份额持有人权益、并不违背交易所和登记结算机构相关规则的情况下可更改上述程序。基金管理人最迟须于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。
五、申购与赎回的数额限制
1、投资人申购、赎回的基金份额需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1000000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。
六、申购和赎回的对价、费用
1、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。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、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知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告。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，保留到小数点后4位，小数点后5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、投资者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。
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分证券数据、现金替代标志、现金替代保证金率、T日可以现金替代比例上限、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。
采用现金替代是为了在相关成份股停牌等情况下便利投资者的申购、提高基金运作的效率，基金管理人在制定具体的现金替代方法时遵循公平及公开的原则，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3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”）和必须现金替代（标志为“必须”）。
禁止现金替代是指在申购、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。
（2）可以现金替代
①适用情形：在通过“可以现金替代比例上限”来控制可以现金替代比例的前提下，如无特殊情况，将除设置为“必须现金替代”和“禁止现金替代”情形以外的股票设置为“可以现金替代”。采用可以现金替代时，应充分考虑由此引发的市场套利行为对基金份额持有人可能造成的利益损害。
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×该证券经除权调整的T-1日收盘价×(1＋现金替代保证金率)
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保证金率，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，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代保证金率，并据此在T+2日收取替代金额。
在T+1日起登记结算机构完成份额券在正常交易的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被替代的部分证券。
T＋3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+3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+1日起，相关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。
T＋3日后第1个工作日(若在特例情况下，则为T+1日起第21个交易日)，基金管理人将应退款和补款的明细数据发送给申购赎回代理券商和基金托管人，现金替代多退少补资金的清算和交收在T＋3日后2个工作日(若在特例情况下，则为T+1日起第22个交易日)内完成，登记结算机构对此提供代收代付服务。
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：

[illegible]

（3）必须现金替代
①适用情形：必须现金替代的证券一般是因标的指数调整将被剔除、或基金管理人出于保护持有人利益原则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经除权调整的T-1日收盘价。
4、预估现金差额相关内容
预估现金差额是指由基金管理人估计并在T日申购赎回清单中公布的当日现金差额的估计值，预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结。
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乘积之和＋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乘积之和)
其中，T日经除权调整后的开盘参考价主要根据中证指数公司所提供的标的指数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”需扣减相应的收益分配数额。预估现金差额的数值可能为正、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+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日投资人申购、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
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

最新公告日期：	20150211
基金名称：	广发中证全指金融地产ETF
基金管理公司名称：	广发基金管理有限公司
基金代码：	159940
标的指数代码：	000992

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)：	1000000.00
基金份额净值(单位：元)：	1.0000

T日 信息内容

预估现金差额(单位：元)：	-9624.00
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)：	1000000
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：	123只
是否开放申购：	是
是否开放赎回：	是
是否开放保证金申购：	否

组合信息内容

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
000001	平安银行	1500	允许	0.21	
000002	万科A	2600	允许	0.21	
000006	深振业A	200	允许	0.21	
000011	深物业A	100	允许	0.21	
000024	招商地产	300	允许	0.21	
000029	深深房A	100	允许	0.21	
000031	中粮地产	200	允许	0.21	
000036	华联控股	200	允许	0.21	
000042	中洲控股	100	允许	0.21	
000043	中航地产	100	允许	0.21	
000046	泛海控股	400	允许	0.21	
000166	申万宏源	1200	允许	0.21	
000402	金融街	600	允许	0.21	
000416	民生控股	100	允许	0.21	
000506	中润资源	100	允许	0.21	
000511	烯碳新材	300	允许	0.21	
000514	渝开发	100	允许	0.21	
000540	中天城投	200	允许	0.21	
000563	陕国投A	100	允许	0.21	
000616	海航投资	400	允许	0.21	
000620	新华联	100	允许	0.21	
000631	顺发恒业	100	允许	0.21	
000656	金科股份	100	允许	0.21	
000667	美好集团	500	允许	0.21	
000671	阳光城	100	允许	0.21	
000686	东北证券	300	允许	0.21	
000718	苏宁环球	200	允许	0.21	
000728	国元证券	300	允许	0.21	
000732	泰禾集团	100	允许	0.21	
000750	国海证券	200	允许	0.21	
000776	广发证券		必须	0.21	18368
000783	长江证券	900	允许	0.21	
000861	海印股份	100	允许	0.21	
000863	三湘股份	100	允许	0.21	
000882	华联股份	200	允许	0.21	
000886	海南高速	200	允许	0.21	
000897	津滨发展	300	允许	0.21	
000926	福星股份	200	允许	0.21	
000931	中关村	100	允许	0.21	
000965	天保基建	100	允许	0.21	
000979	中弘股份	300	允许	0.21	
002016	世荣兆业	100	允许	0.21	
002142	宁波银行	100	允许	0.21	
002146	荣盛发展	200	允许	0.21	
002244	滨江集团	100	允许	0.21	
002285	世联行	100	允许	0.21	
002305	南国置业	100	允许	0.21	
002500	山西证券	300	允许	0.21	
002673	西部证券	100	允许	0.21	
600000	浦发银行	2900	允许	0.21	
600015	华夏银行	1200	允许	0.21	
600016	民生银行	7100	允许	0.21	
600030	中信证券	2100	允许	0.21	
600036	招商银行	4300	允许	0.21