（上接A14版）

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：每日日终，发售代理机构将当日的股票认购数据按投资人证券账户汇总发给基金管理人，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者证券账户汇总发送给基金管理人，基金管理人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将投资者网下认购股票过户至本基金组合证券认购专户，完成验资后划入基金证券账户。以基金份额方式支付佣金的，基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的佣金，并从投资者的认购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额。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者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）if表投资者提交认购申请的第i只股票，n代表投资者提交的股票总只数。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，则由于投资者获得了相应的权益，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+每股配股比例）

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并据此进行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，则按照各投资人的认购申报数量同比例收取。

②若某一股票在网下股票认购日至登记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发送的解冻数据对投资者的有效认购数量进行相应调整。

7、特别提示：投资者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

募集期间现金认购资金全部存入本基金募集专户，投资者现金认购款项在募集期间前所产生的利息归投资者所有，在本基金募集结束后，折算为基金份额计入投资者的账户。

投资者以股票认购的，认购股票由登记机构予以冻结，冻结期间的权益归投资者所有。

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，在基金合同生效前，任何人不得动用。募集的股票由登记结算机构予以冻结。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。

十六、发行联接基金或增设新的份额类别

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，基金管理人可根据基金发展需要，募集并管理以本基金为目标ETF的一只或多只联接基金，或将旗下跟踪同一标的指数的指数基金转型为本基金的联接基金，或为本基金增设新的份额类别。

第七部分　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（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，并在下一个工作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开始收益之日起，《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，并加计银行同期活期存款利息，同时将已冻结的股票解冻；

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投酬。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5000万元的，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。

法律法规另有规定时，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，无需召开基金份额持有人大会审议。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，本基金具备下列条件的，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上市：

1、基金募集金额（含募集股票市值）不低于2亿元。

2、基金份额持有人不少于1000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前按相关法律法规要求发布基金份额上市交易公告书。

二、基金份额的上市交易

基金份额在深圳证券交易所的上市交易需遵照《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交易和申购赎回实施细则》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体发布基金恢复上市公告。

四、基金份额的终止上市交易

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提前终止上市；

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。

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。

若届时本基金管理人已有以该指数作为标的指数基金，基金管理人将本着维护基金份额持有人合法权益的原则，履行适当的程序后可以选取其他合适的指数作为标的指数。

五、基金份额参考净值的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前公告当日的申购、赎回清单，深圳证券交易所在开市后根据申购、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对外发布，仅供投资者交易、场内申购、赎回基金份额时参考。

1、基金份额参考净值计算公式

基金份额参考净值＝（申购赎回清单中必须现金替代的替代金额+申购赎回清单中可以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部分）/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。若深圳证券交易所调整有关基金份额参考净值保留位数，本基金将相应调整。

3、深圳证券交易所和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，本基金在履行适当程序后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。

第十部分　基金份额的申购与赎回

本基金的基金份额分为场内份额与场外份额两种，分别适用不同的申购赎回办法。

一、申购与赎回的场所

（一）场内申购与赎回

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）场外申购与赎回

对于在场外申购、赎回的投资人，应当在基金管理人或其指定的其他销售机构办理本基金的申购和赎回，基金管理人在开始场外申购、赎回业务前公告有关场外申购赎回的具体办法，包括但不限于：适用场外申购赎回方式的条件、开放日场外申购赎回的截止时间、业务规则等等。

在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可根据市场情况停止办理场外申购赎回业务。在决定停止场外申购赎回业务情况下，基金管理人应采取适当措施对原有场外份额持有人作出妥善安排并提前公告。

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场内基金份额的申购和赎回，具体办理时间为深圳证券交易所的正常交易日的正常交易时间；投资者办理场外基金份额的申购和赎回等业务的开放日为深圳证券交易所的正常交易日，具体办理时间见本基金招募说明书和相关公告；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。

本基金场外申购和赎回的开放时间与场内申购和赎回的开放时间可能存在差异，投资者应关注基金管理人发布的有关公告并注意其提交交易申请的时间。　场外投资者在开放时间以外提交的申购、赎回等交易申请，且登记结算机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日基金份额申购、赎回的价格。

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。

本基金场外申购赎回的开始时间与场内申购赎回的开始时间可能存在差异，投资者应关注基金管理人发布的有关公告。

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。

本基金可在基金上市交易之前开始办理申购、赎回，但在申请上市期间基金可暂停办理申购、赎回业务。

三、申购与赎回的原则

1、基金场内申购和赎回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；本基金的场外份额采用金额申购、份额赎回的方式，即申购以金额申请、赎回以份额申请。

2、基金场内份额的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价；本基金场外份额的申购对价、赎回对价为现金。

3、场内申购、赎回申请提交后不得撤销；当日的场外申购、赎回申请可以在当日业务办理时间结束前撤销，在当日的业务办理时间结束后不得撤销。

4、场外份额申购赎回遵循"未知价"原则，即申购、赎回价格以申请当日　收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

5、场外份额赎回遵循"先进先出"原则，即按照投资人申购的先后次序进　行顺序赎回。

6、本基金场内申购、赎回应遵守《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》的规定。如深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司修改或更新上述规则并适用于本基金的，则按照新的规则执行，并在招募说明书中进行更新；本基金场外申购、赎回应遵守广发基金管理有　限公司的相关业务规则。

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、场内申购与赎回的程序

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的规定备足申购对价，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

投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。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或投资人提交的赎回申请超过基金管理人设定的当日净赎回份额上限、当日累计赎回份额上限、单个账户当日净赎回份额上限或单个账户当日累计赎回份额上限，则赎回申请失败。

基金销售机构受理申购、赎回申请并不代表该申购、赎回申请一定成功。申购、赎回的确认以登记结算机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

3、申购与赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的基金份额、组合证券、现金替代、现金差额及其他对价的清算交收适用《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳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。

投资者"T日申购、赎回成功后，登记结算机构在"T日收市后为投资者办理基金组合证券的清算交收以及基金份额、现金替代等的清算，在T+1日办理基金份额、现金替代等的交收以及现金差额的清算，在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人，基金托管人根据登记结算机构的结算通知和基金管理人的划款通知办理资金的划拨。

如果登记结算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《《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳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、登记结算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，并在开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

五、场外申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资者必须根据基金管理人规定的程序，在开放日的开放时间内提出申购或赎回的申请。投资者在提交申购申请时须全额交付申购款项，并在规定的截止时间前划到销售机构指定的账户上，投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请不成立而不予成交。具体见本基金招募说明书。

2、申购和赎回申请的确认

基金管理人在场外申购、赎回开放日截止时间前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（　T日），在正常情况下，本基金登记结算机构在T+1日对该交易的有效性进行确认。申购、赎回的确认以基金登记结算机构的确认结果为准。

3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，投资人交付申购款项，申购成立；登记结算机构确认基金份额时，申购生效。若申购资金在规定的截止时间内未全额到账，则申购不成立。若申购不成立或无效，基金管理人将投资者已缴付的申购款项本金退还给投资者。基金管理人将在接受投资者有效赎回申请之日起七个工作日内支付赎回款项。在发生场外巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

4、申购和赎回的注册登记

正常情况下，投资者　T　日申购基金成功后，登记结算机构在　T+1　日为投资者增加权益并办理注册登记手续，投资人自　T+1　日起有权申请赎回该部分基金份额，或在条件许可情况下申请办理跨系统转托管；基金份额持有人　T　日赎回基金成功后，正常情况下，登记结算机构在　T+1　日为投资者办理扣除权益的注册登记手续；在法律法规允许的范围内，登记结算机构可以对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质损害投资者的合法权益，基金管理人最迟于实施前在指定媒体上公告。

5、申购和赎回的投资交易

对于　T　日截止时间前收到的有效申购及有效赎回申请，基金管理人将根据轧差之后的净申购金额或净赎回数量，按尽可能贴近收盘价的原则，争取在T日完成相应的证券交易。

六、场内申购与赎回的数额限制

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500000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，调整场内申购或赎回的数量或比例限制。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。

七、场外申购与赎回的数额限制

1、投资者每次申购的单笔最低金额为人民币100万元，每次赎回的单笔最低份额为50万份。

2、投资者可将其全部或部分基金份额赎回。单笔赎回不得少于　50　万份（如该账户在该场外销售机构托管的基金份额余额不足50万份，则必须一次性赎回该基金全部场外份额）；若某笔赎回将导致投资者在该场外销售机构托管的该只基金份额余额不足　50　万份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的该基金剩余场外份额一次性全部赎回。

3、上述规定详见基金管理人相关业务规则。基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

八、场内申购和赎回的对价、费用及其用途

1、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。赎回对价是指基金份额持有人赎回基金份额时，基金管理人应交付的组合证券、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。

2、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、登记结算机构等收取的相关费用。

3、本基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5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日收市后计算，并在T+1日内公告，计算公式为估值日基金资产净值除以估值日基金份额总数。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。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。

九、场外申购和赎回的价格、费用及其用途

1、申购份额的计算及余额的处理方式：申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份，份额计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，申购费用以人民币元为单位，四舍五入保留至小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

2、赎回金额的计算及处理方式：赎回金额为赎回份额乘以当日基金份额净值减去赎回相关费用（如有），赎回金额、赎回费用的单位为人民币元，四舍五入保留到小数点两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

3、投资者在申购或赎回基金份额时，基金管理人参考当时市场的交易佣金、印花税等相关交易成本水平，收取一定的申购费和/或赎回费并按规定计提相应比例归入基金资产，力争覆盖场外现金申赎引起的证券交易费用和操作成本。当前的申购、赎回费率如下：申购费率为0.05%，赎回费率为0.15%。

本基金的申购费由申购人承担，赎回费由赎回人承担，基金管理人可根据市场情况，在履行适当程序后，调整申购费率、赎回费率，经公告后实施。

4、申购份额、赎回金额的计算方式：

（1）申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额，其通用的计算方式为：

净申购金额=申购金额÷（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份数=净申购金额÷T日基金份额净值

（2）基金赎回金额的计算

赎回费用=赎回份额×T　日基金份额净值×赎回费率

赎回金额=赎回份额×T　日基金份额净值-赎回费用

5、由于场内与场外申购、赎回方式上的差异，本基金投资者依据基金份额净值所支付的场外申购或取得的场外赎回的现金对价；与场内申购所支付或场外赎回所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、场内申购、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、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固定现金作为替代。

（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。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×该证券前一交易日除权除息后的收盘价×（1＋现金替代溢价比率）

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参考价格可能有所差异。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率，并提此收取替代金额。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率，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N+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。N＋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N+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，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N+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）、配股以及由于股权分置改革等发生的权益变动，则进行相应调整。

N+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数据发送给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资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：

[illegible]

其中，参考基金份额净值目前为该ETF前一交易日除权除息后的收盘价，如果深圳证券交易所参考基金份额净值计算方式发生变化，以深圳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调整后T日开盘参考价。

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。

预估现金部分的计算公式为：

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、赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与该证券T　日经除权除息调整的前收盘价相乘之和+申购、赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与该证券T　日经除权除息调整的前收盘价相乘之和）

其中，该证券T　日经除权除息调整的前收盘价由深圳证券交易所提供。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

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：	20160603
基金名称：	XXXXXX
基金管理公司名称：	广发基金管理有限公司
基金代码：	XXXXXX
标的指数代码	399006

2016-6-3日　信息内容

现金差额：	0.00元
最小申购、赎回单位资产净值：	1,094,300.00元
基金份额净值：	2.1886元

206-6-3日　信息内容

预估现金差额：	-8026.00元
最小申购、赎回单位：	500,000份
T日最小申购赎回单位分红金额	0.00元
可以现金替代比例上限：	45%
申购赎回组合证券只数	100
是否需要公布IOPV：	是
是否允许申购	是
是否允许赎回	是
当天累计申购份额上限	不设上限
当天累计赎回份额上限	不设上限
单个账户当天累计申购份额上限	不设上限
单个账户当天累计赎回份额上限	不设上限
当天净申购份额上限	不设上限
当天净赎回份额上限	不设上限
单个账户当天净申购份额上限	不设上限
单个账户当天净赎回份额上限	不设上限

成份股信息内容

证券代码	证券简称	股票数量	现金替代标志	可以现金替代保证金率	申购替代金额	赎回替代金额	挂牌市场
300001	特锐德	500	允许	15%			深圳市场
300002	神州泰岳	1100	允许	15%			深圳市场
300003	乐普医疗	600	允许	15%			深圳市场
300004	南风股份	300	允许	15%			深圳市场
300005	探路者	300	允许	15%			深圳市场
300010	立思辰	500	允许	15%			深圳市场
300011	鼎汉技术	300	允许	15%			深圳市场
300012	华测检测	700	允许	15%			深圳市场
300015	爱尔眼科	400	允许	15%			深圳市场
300017	网宿科技	500	允许	15%			深圳市场
300020	银江股份	500	允许	15%			深圳市场
300024	机器人	1200	允许	15%			深圳市场
300026	红日药业	500	允许	15%			深圳市场
300027	华谊兄弟	1700	允许	15%			深圳市场
300032	金龙机电	300	允许	15%			深圳市场
300033	同花顺	200	允许	15%			深圳市场
300039	上海凯宝	600	允许	15%			深圳市场
300043	互动娱乐	600	允许	15%			深圳市场
300052	中青宝	200	允许	15%			深圳市场
300053	欧比特	500	允许	15%			深圳市场
300055	万邦达	700	允许	15%			深圳市场
300058	蓝色光标	1500	允许	15%			深圳市场
300059	东方财富	2300	允许	15%			深圳市场
300068	南都电源	500	允许	15%			深圳市场
300070	碧水源	1700	允许	15%			深圳市场
300072	三聚环保	600	允许	15%			深圳市场
300075	数字政通	300	允许	15%			深圳市场
300077	国民技术	600	允许	15%			深圳市场
300078	思创医惠	300	允许	15%			深圳市场
300079	数码视讯	1400	允许	15%			深圳市场
300085	银之杰	300	允许	15%			深圳市场
300088	长信科技	900	允许	15%			深圳市场
300090	盛运环保	700	允许	15%			深圳市场
300096	易联众	400	允许	15%			深圳市场
300101	振芯科技	400	允许	15%			深圳市场
300104	乐视网	1100	允许	15%			深圳市场
300113	顺网科技	400	允许	15%			深圳市场
300115	长盈精密	500	允许	15%			深圳市场
300122	智飞生物	400	允许	15%			深圳市场
300124	汇川技术	1100	允许	15%			深圳市场
300133	华策影视	800	允许	15%			深圳市场
300134	大富科技	300	允许	15%			深圳市场
300136	信维通信	700	允许	15%			深圳市场
300142	沃森生物	1100	允许	15%			深圳市场
300144	宋城演艺	600	允许	15%			深圳市场
300146	汤臣倍健	600	允许	15%			深圳市场
300147	香雪制药	500	允许	15%			深圳市场
300152	科融环境	600	允许	15%			深圳市场
300156	神雾环保	600	允许	15%			深圳市场
300159	新研股份	700	允许	15%			深圳市场
300166	东方国信	400	允许	15%			深圳市场
300168	万达信息	800	允许	15%			深圳市场
300170	汉得信息	700	允许	15%			深圳市场
300171	东富龙	300	允许	15%			深圳市场
300178	腾邦国际	400	允许	15%			深圳市场
300182	捷成股份	500	允许	15%			深圳市场
300188	美亚柏科	200	允许	15%			深圳市场
300199	翰宇药业	500	允许	15%			深圳市场
300202	聚龙股份	300	允许	15%			深圳市场
300203	聚光科技	300	允许	15%			深圳市场
300205	天喻信息	300	允许	15%			深圳市场
300207	欣旺达	400	允许	15%			深圳市场
300212	易华录	200	允许	15%			深圳市场
300216	千山药机	500	允许	15%			深圳市场
300226	上海钢联	100	允许	15%			深圳市场
300228	富瑞特装	400	允许	15%			深圳市场
300229	拓尔思	200	允许	15%			深圳市场
300231	银信科技	300	允许	15%			深圳市场
300238	冠昊生物	200	允许	15%			深圳市场
300244	迪安诊断	300	允许	15%			深圳市场
300251	光线传媒	1000	允许	15%			深圳市场
300252	金信诺	200	允许	15%			深圳市场
300253	卫宁健康	600	允许	15%			深圳市场
300257	开山股份	400	允许	15%			深圳市场
300267	尔康制药	700	允许	15%			深圳市场
300271	华宇软件	500	允许	15%			深圳市场
300273	和佳股份	500	允许	15%			深圳市场
300274	阳光电源	400	允许	15%			深圳市场
300276	三丰智能	200	允许	15%			深圳市场
300287	飞利信	700	允许	15%			深圳市场
300288	朗玛信息	100	允许