（上接D5版）

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》及其他法律法规、《基金合同》的有关规定募集。

本基金募集申请已经中国证监会2010年3月26日证监许可［2010］378号文核准。

（二）基金类型

股票型

（三）基金的运作方式

交易型开放式

（四）标的指数

上证社会责任指数

（五）基金存续期间

不定期

（六）基金的面值、认购价格

本基金每份基金份额的初始面值为人民币1.00元，认购价格为人民币1.00元。

（七）基金发售对象、方式和场所

1、发售对象

个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者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。

2、发售方式

投资者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者通过基金管理人指定的发售代理机构利用上海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者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行认购。

网下股票认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构以股票进行认购。

3、发售场所

投资者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）基金份额的认购

1、基金份额的发售期限

本基金募集期限为自基金份额发售之日起不超过3个月。

本基金自2010年4月21日起至2010年5月21日止通过销售机构公开发售（详见基金份额发售公告）。其中，网下现金发售期间为2010年4月21日至2010年5月21日；网上现金发售日期为2010年5月21日；通过发售代理机构进行网下股票认购的发售期间为2010年5月18日至2010年5月21日。

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。

2、认购开户

投资者认购本基金时需持有证券账户，证券账户是指上海证券交易所A股账户（以下简称“A股账户”）或上海证券交易所证券投资基金账户。

①如投资者需新开立证券账户，则应注意：

1）上海证券交易所证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易，如投资者需要参与网下股票认购或基金分额的申购、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至少提前1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

3、基金份额的认购费用、认购价格及认购份额的计算

①认购价格：本基金份额的认购价格为1.00元价。

②认购费用：

本基金的认购费用由投资者承担，认购费率不高于1%，认购费率如下表：

认购份额（U）	认购费率
U<50万份	1.0%
50万份≤U<100万份	0.5%
U≥100万份	1000元/笔

基金管理人办理网下现金认购，按照本招募说明书所示上述费率结构收取认购费用；发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时，可参照上述费率结构收取一定的佣金。

③网上现金认购

1）认购时间：2010年5月21日9:30-11:30和13:00-15:00。

2）通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算：

通过发售代理机构进行网上现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购佣金、认购金额的计算公式为：

认购佣金=认购份额×（1+佣金比率）

认购金额=认购份额×（1+佣金比率）

认购佣金由发售代理机构收取，投资者需以现金方式交纳认购佣金。

例：某投资者通过某发售代理机构采用现金方式认购1,000份本基金，假设该发售代理机构确认的佣金比率为1.0%，则需准备的资金金额计算如下：

认购佣金=1,000×1.0%=10元

认购金额=1,000×（1+1.0%）=1,010元

即投资者需准备1,010元资金，方可认购到1,000份本基金基金份额。

3）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须为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。

4）认购手续：投资者在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。网上现金认购申请提交后，投资者可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。

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，注册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T+1日通知各发售代理机构，发售协调人于T+2日将实际到位的认购资金划往基金募集专户。

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。

④网下现金认购

1）认购时间：2010年4月21日至2010年5月21日止通过销售机构公开发售（详见基金份额发售公告）。其中，网下现金发售期间为2010年4月21日至2010年5月21日；网上现金发售日期为2010年5月21日；通过发售代理机构进行网下股票认购的发售期间为2010年5月18日至2010年5月21日。

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。

2、认购开户

投资者认购本基金时需持有证券账户，证券账户是指上海证券交易所A股账户（以下简称“A股账户”）或上海证券交易所证券投资基金账户。

①如投资者需新开立证券账户，则应注意：

1）上海证券交易所证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易，如投资者需要参与网下股票认购或基金分额的申购、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至少提前1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

3、基金份额的认购费用、认购价格及认购份额的计算

①认购价格：本基金份额的认购价格为1.00元价。

②认购费用：

本基金的认购费用由投资者承担，认购费率不高于1%，认购费率如下表：

认购份额（U）	认购费率
U<50万份	1.0%
50万份≤U<100万份	0.5%
U≥100万份	1000元/笔

基金管理人办理网下现金认购，按照本招募说明书所示上述费率结构收取认购费用；发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时，可参照上述费率结构收取一定的佣金。

③网上现金认购

1）认购时间：2010年5月21日9:30-11:30和13:00-15:00。

2）通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算：

通过发售代理机构进行网上现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购佣金、认购金额的计算公式为：

认购佣金=认购份额×（1+佣金比率）

认购金额=认购份额×（1+佣金比率）

认购佣金由发售代理机构收取，投资者需以现金方式交纳认购佣金。

例：某投资者通过某发售代理机构采用现金方式认购1,000份本基金，假设该发售代理机构确认的佣金比率为1.0%，则需准备的资金金额计算如下：

认购佣金=1,000×1.0%=10元

认购金额=1,000×（1+1.0%）=1,010元

即投资者需准备1,010元资金，方可认购到1,000份本基金基金份额。

3）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须为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。

4）认购手续：投资者在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。网上现金认购申请提交后，投资者可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。

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，注册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T+1日通知各发售代理机构，发售协调人于T+2日将实际到位的认购资金划往基金募集专户。

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。

④网下股票认购

1）认购时间：2010年4月21日至2010年5月21日，具体业务办理时间由基金管理人及其指定发售代理机构确定。

2）认购限额：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，最高不得超过99,999,000份；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10万份以上（含10万份），超过部分须为1万份的整数倍。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认购金额的计算：

通过基金管理人进行网下现金认购的投资者，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=认购份额×认购费率

认购金额=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/基金份额初始面值

认购费用由基金管理人收取，投资者需以现金方式交纳认购费用。

例：某投资者通过基金管理人认购本基金500,000份，认购费率为0.5%，假定认购金额产生的利息为100元，则该投资人的认购金额为：

认购费用=500,000×0.5%=2500元

认购金额=500,000×（1+0.5%）=502,500元

该投资者所得认购份额为：

净认购份额=500,000+1001.00=500,100份

即，若该投资者通过基金管理人认购本基金500,000份，则该投资者的认购金额为502,500元，假定该笔认购金额产生的利息为100元，则可得到500,100份基金份额。

4）通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算与通过发售代理机构进行网上现金认购的计算方式相同。

5）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，最高不得超过99,999,000份；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10万份以上（含10万份），超过部分须为1万份的整数倍。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

6）认购手续：投资者在认购本基金时，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。网下现金认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

7）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相应划往基金募集专户。其中，认购款项利息将折算为基金份额归投资者所有。

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代该投资者提交网上现金认购申请。之后，注册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代该投资者提交网上现金认购申请。之后，注册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基金募集专户。

8、认购确认：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。

⑤网下股票认购

1）认购时间：通过发售代理机构进行网下股票认购的时间为2010年5月18日至2010年5月21日，具体业务办理时间由发售代理机构确定。

2）认购限额：网下股票认购以单只股票股数申报。投资者通过发售代理机构进行网下股票认购，单只股票最低认购申报股数为1,000股，超过1,000股的部分须为100股的整数倍，用于认购的股票必须是上证社会责任指数成份股和已公告的备选成份股（具体见基金份额发售公告）。投资者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：投资者在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购股票。网下股票认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

4）特殊情形

A、已公告的将被调出上证社会责任指数的成份股不得用于认购本基金。

B、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至少3个工作日公告限制认购规模的个股名单。

C、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

投资者通过发售代理机构办理网下股票认购，募集期最后一日日终，发售代理机构将所有的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。注册登记机构根据基金管理人提供的确认数据将投资者账户内相应的股票冻结。基金募集期结束后，基金管理人根据有效认购数量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。注册登记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，并根据基金管理人报上海证券交易所确认的有效认购申请股票数据，将投资者申请认购的股票过户到基金的证券账户。

5）认购份额的计算公式：

投资者的认购份额=∑（第i只股票在股票认购期最后一日的均价×有效认购数量）/1.00

其中：

A、i代表投资者提交认购申请的第i只股票，如投资者仅提交了1只股票的申请，则i=1。

B、第i只股票在网下股票认购期最后一日的均价"由基金管理人根据上海证券交易所的当日行情数据，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。若该股票在当日停牌或无成交，则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某一股票在网下股票认购期最后一日至注册登记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，由于投资者仍获得了相应的权益，基金管理人将按如下方式对该股票在股票认购期最后一日的均价进行调整：

a.除息：调整后价格=网下股票认购期最后一日均价-每股现金股利或股息

b.送股：调整后价格=网下股票认购期最后一日均价/（1+每股送股比例）

c.配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例）/（1+每股配股比例）

d.送股且配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例）/（1+每股送股比例+每股配股比例）

e.除息且送股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价-每股现金股利或股息）/（1+每股送股比例）

f.除息且配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例-每股现金股利或股息）/（1+每股配股比例）

g.除息、送股且配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+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）

C、有效认购数量"是指由基金管理人确认的并据此以进行清算交收的股票股数。其中：

a.对于经公告限制认购规模的个股，如果投资者申报的个股认购数量总额大于下述公式计算的，基金管理人有权对投资者的认购申报数量进行部分确认：

$$Cash = \sum_{i=1}^{n} \left(\frac{Cash_i}{\sum_{i=1}^{n} Cash_i} \times \frac{Cash}{P_i} \right) \times P_i$$

$Cash$为网上现金认购和网下现金认购的合计申请数额，$\sum_{i=1}^{n} Cash_i$为除限制认购规模的个股和基金管理人全部或部分临时拒绝的个股以外的其它个股在网下股票认购期最后一日均价和认购申报数量乘积，n为该限制认购规模的个股按均价计算的其在网下股票认购期最后一日在标的指数中的权重（认购期间如有标的指数调整公告，则基金管理人根据公告调整后的成份股名单以及标的指数编制规则计算调整后的各成份股权重），并以其作为计算依据），P_i为该股在网下股票认购期最后一日的均价。

b.若某一股票在网下股票认购期最后一日至注册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注册登记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。

4、募集期利息和股票的处理方式

通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在划入基金募集专户前所产生的利息，归投资者所有；有效认购资金自划入基金募集专户起至基金合同生效日止的利息计入基金资产；投资者以股票认购的，认购股票由注册登记机构予以冻结，冻结期间的权益归投资者所有。

七、基金合同的生效

（一）基金备案的条件

1、基金募集期限届满，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，并且基金份额持有人的人数不少于200人的条件下，基金管理人应当自募集期限届满之日起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，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，《基金合同》生效。

2、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。

3、本基金《基金合同》生效前，基金募集期间募集的资金存入专门账户，任何人不得动用；网下股票认购所募集的股票由注册登记机构予以冻结。

4、法律法规另有规定时，从其规定。

（二）基金募集失败时的处理方式

1、基金募集期限届满，未达到《基金合同》生效条件，或基金募集期内发生不可抗力使《基金合同》无法生效，则基金募集失败。

2、如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，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；对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票，注册登记机构应予以解冻。

（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，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

八、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《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、《上海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，基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金份额获准在上海证券交易所上市的，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）基金份额的上市交易

基金份额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《业务细则》等有关规定。

（三）终止上市交易

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份额的上市交易，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、上海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上海证券交易所终止基金上市的决定之日起2个工作日内发布基金份额终止上市交易公告。

九、基金份额的申购与赎回

（一）申购与赎回的场所

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本基金的申购和赎回。

基金管理人在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单，并可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商。

（二）申购与赎回办理的开放日及时间

1、申购、赎回业务开始日

本基金可在基金上市交易之前开始办理申购。但在基金申请上市期间，基金可暂停办理申购。

本基金的赎回自《基金合同》生效后不超过3个月的时间内开始办理。

基金管理人应在办理申购开始日、赎回开始日前2日在至少一家指定媒体及基金管理人互联网网站（以下简称“网站”）公告。

2、申购、赎回的开放日及开放时间

申购和赎回的开放日为上海证券交易所的交易日，开放时间为9:30-11:30和13:00-15:00。但基金管理人根据法律法规、中国证监会或《基金合同》规定公告暂停、赎回时除外。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回开放日及开放时间进行调整，但此项调整应在实施日2日前在指定媒体公告。

（三）申购与赎回的原则

1、“份额申购、份额赎回”原则，即本基金的申购、赎回均以份额申请；

2、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；

3、申购、赎回申请提交后不得撤销；

4、申购、赎回应遵守上海证券交易所《业务细则》的规定；

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

（四）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请

投资者必须根据申购赎回代理券商规定的程序，在开放日的开放时间提出申购或赎回的申请。

投资者在提交申购申请时，须根据申购赎回清单备足相应数量的股票和现金；投资者在提交赎回申请时，必须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。

3、申购和赎回的清算交收与登记

投资者T日申购、赎回成功后，注册登记机构在T日收市后为投资者办理基金份额与组合证券的清算交收以及现金替代等的清算，在T+1日办理现金替代等的交收以及现金差额的清算，并将结果发送给申购赎回代理券商和基金托管人。由基金管理人和申购赎回代理券商在T+2日办理现金差额的交收。如果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《中国证券登记结算有限责任公司交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

注册登记机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整，并最迟于开始实施日的3个工作日前在指定媒体公告。

（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最小申购赎回单位的整数倍。

本基金最小申购赎回单位为50万份，基金管理人有权对其进行更改，并在更改前至少3个工作日依照有关规定在指定媒体上予以公告。

（六）申购、赎回的对价及费用

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的人的组合证券、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上海证券交易所开市前公告。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。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。申购赎回清单的内容与格式见本基金招募说明书。

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、注册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、现金替代、T日现金替代的溢价比例、T日允许现金替代的最高比例、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、申购赎回清单组合证券相关内容

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、最小申购赎回单位

最小申购赎回单位是基金申购赎回的最基本单位。

4、申购赎回清单现金替代相关内容

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，或基金管理人认为可以采用现金替代的其他情形。

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）

目前，“该证券参考价格”的确定原则为：

A、该证券正常交易时，采用最新成交价；

B、该证券正常交易中出现涨停/跌停时，采用涨停/跌停价格；

C、该证券停牌且当日有成交时，采用前收盘价（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。

参考基金份额净值目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。

收取可以现金替代溢价的原因是，对于使用可以现金替代的证券，基金管理人需随后买入，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（不含T日），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：为更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：

$$\text{现金替代比例} = \frac{\sum_{i=1}^{n} \text{现金替代溢价比例}_i \times \text{现金替代金额}_i + \sum_{i=1}^{n} \text{固定替代金额}_i}{\text{申购份额净值}}$$

⑤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，或基金管理人出于保护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。

5、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。

本基金T日申购赎回清单中公告预估现金部分计算公式为：

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日预计开盘价乘积之和+申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日预计开盘价乘积之和）

其中，T日预计开盘价主要根据交易所提供的标的指数成份证券的预计开盘价确定。

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。

6、申购赎回清单现金差额相关内容

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对应的基金份额-T日基金份额净值-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。

7、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	2010年3月31日
基金名称	上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金
基金管理人公司名称	建信基金管理有限责任公司
一级市场基金代码	510091
2010年3月30日信息内容	
现金差额（单位：元）	4,481
最小申购赎回单位资产净值（单位：元）	525,180
基金份额净值（单位：元）	1.050
2010年3月31日信息内容	
预估现金部分（单位：元）	4,525
现金替代比例上限	20%
是否需要公布IOPV	是
最小申购赎回单位（单位：份）	500,000
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	现金替代溢价比例	固定替代金额
600000	浦发银行	1300	允许	10%	
600004	白云机场	100	允许	10%	
600016	民生银行	4700	允许	10%	
600019	宝钢股份	1300	允许	10%	
600022	济南钢铁	300	允许	10%	
600026	中海发展	100	允许	10%	
600030	中信证券	1100	允许	10%	
600031	三一重工	100	允许	10%	
600033	福建高速	200	允许	10%	
600036	招商银行	3000	允许	10%	
600050	中国联通	2100	允许	10%	
600056	中国医药	100	允许	10%	
600058	五矿发展	100	允许	10%	
600060	海信电器	100	允许	10%	
600062	双鹤药业	100	允许	10%	
600066	宇通客车	100	允许	10%	
600068	葛洲坝	400	允许	10%	
600085	同仁堂	100	允许	10%	
600100	同方股份	100	允许	10%	
600102	莱钢股份	100	允许	10%	
600111	包钢稀土	100	允许	10%	
600118	中国卫星	100	允许	10%	
600123	兰花科创	100	允许	10%	
600138	中青旅	100	允许	10%	
600153	建发股份	100	允许	10%	
600166	福田汽车	100	允许	10%	
600170	上海建工	100	允许	10%	
600177	雅戈尔	200	允许	10%	
600188	兖州煤业	100	允许	10%	
600195	中牧股份	100	允许	10%	
600196	复星医药	100	允许	10%	
600219	南山铝业	200	允许	10%	
600246	万通地产	100	允许	10%	
600261	浙江阳光	100	允许	10%	
600263	路桥建设	100	允许	10%	
600267	海正药业	100	允许	10%	
600269	赣粤高速	200	允许	10%	
600270	外运发展	100	允许	10%	
600271	航天信息	100	允许	10%	
600303	曙光股份	100	允许	10%	
600308	华泰股份	100	允许	10%	
600309	烟台万华	100	允许	10%	
600317	营口港	100	允许	10%	
600325	华发股份	100	允许	10%	
600332	广州药业	100	允许	10%	
600337	美克股份	100	允许	10%	
600351	亚宝药业	100	允许	10%	
600352	浙江龙盛	200	允许	10%	
600362	江西铜业	100	允许	10%	
600383	金地集团	400	允许	10%	
600389	江山股份	100	允许	10%	
600396	金山股份	100	允许	10%	
600428	中远航运	100	允许	10%	
600432	吉恩镍业	100	允许	10%	
600439	瑞贝卡	100	允许	10%	
600456	宝钛股份	100	允许	10%	
600495	晋西车轴	100	允许	10%	
600496	精工钢构	100	允许	10%	
600497	驰宏锌锗	100	允许	10%	
600498	烽火通信	100	允许	10%	
600499	科达机电	100	允许	10%	
600500	中化国际	100	允许	10%	
600511	国药股份	100	允许	10%	
600528	中铁二局	100	允许	10%	
600531	豫光金铅	100	允许	10%	
600535	天士力	100	允许	10%	
600549	厦门钨业	100	允许	10%	
600550	天威保变	100	允许	10%	
600557	康缘药业	100	允许	10%	
600580	卧龙电气	100	允许	10%	
600588	用友软件	100	允许	10%	
600595	中孚实业	100	允许	10%	
600596	新安股份	100	允许	10%	
600600	青岛啤酒	100	允许	10%	
600611	大众交通	100	允许	10%	
600616	金枫酒业	100	允许	10%	
600685	广船国际	100	允许	10%	
600690	青岛海尔	200	允许	10%	
600717	天津港	200	允许	10%	
600718	东软集团	100	允许	10%	
600750	江中药业	100	允许	10%	
600755	厦门国贸	100	允许	10%	
600761	安徽合力	100	允许	10%	
600835	上海机电	100	允许	10%	
600839	四川长虹	300	允许	10%	
600879	航天电子	100	允许	10%	
600962	国投中鲁	100	允许	10%	
600970	中材国际	100	允许	10%	
600973	宝