# 上证民营企业50交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告

鹏华基金管理有限公司

二〇一〇年十月二十六日

## 一、重要声明与提示

上证民营企业50交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书暨开放日常申购赎回公告依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，鹏华基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查本基金管理人于2010年6月25日、28日、29日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和鹏华基金管理有限公司网站（www.phfund.com.cn）的本基金招募说明书。

## 二、基金概览

1、基金二级市场交易简称：民企ETF。
2、一级市场交易代码：510070。
3、基金申购、赎回简称：民企申赎。
4、申购、赎回代码：510071。
5、2010年10月22日基金份额总额：863,124,067份。
6、2010年10月22日基金份额净值：1.296元。
7、本次上市交易份额：863,124,067份。
8、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
9、上市交易日期：2010年10月29日。
10、基金管理人：鹏华基金管理有限公司。
11、基金托管人：中国工商银行股份有限公司。
12、上市推荐人：中银万国证券股份有限公司。
13、申购赎回代办券商（以下简称“一级交易商”）：海通证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、湘财证券有限责任公司。

## 三、基金的募集与上市交易

（一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可［2010］747号文。
2、基金运作方式：交易型、开放式。
3、基金合同期限：不定期。
4、发售日期：本基金自2010年7月1日起至2010年7月29日通过销售机构公开发售。其中，网下现金发售期间为2010年7月1日起至2010年7月29日，网上现金发售日期为2010年7月27日至2010年7月29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7月23日起至2010年7月29日，通过基金管理人进行网下股票认购的发售日期为2010年7月29日。
5、发售价格：1.00元人民币。
6、发售期限：网下现金发售21个工作日，网上现金发售3个工作日，通过发售代理机构进行网下股票认购5个工作日。
7、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3种方式。
8、发售机构
①直销机构
投资者可通过本基金管理人的直销机构办理本基金的网下现金及网下股票认购。
②代销机构
本基金的网下现金发售和网下股票发售的发售代理机构为：国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、华泰联合证券、招商证券、广发证券、银河证券、海通证券、中银万国证券、兴业证券、湘财证券、渤海证券、华泰证券、长城证券、东北证券、上海证券、平安证券、东海证券、中信证券、山西证券、东吴证券、东兴证券、万联证券、光大证券、东莞证券、金元证券、中信金通证券、宏源证券、西部证券、江南证券、华安证券、安信证券、财富证券、财通证券、中投证券、万联证券、中山证券、第一创业证券、华林证券、世纪证券、广州证券、浙商证券、国联证券、江海证券、方正证券、中山证券、华西证券、红塔证券、厦门证券、华宝证券、国金证券、信达证券、华龙证券、民生证券、广发华福证券、东兴证券等。

本基金的网上现金发售和网下股票发售的发售代理机构为：国泰君安证券、中信建投证券、国信证券、华泰联合证券、招商证券、广发证券、银河证券、海通证券、中银万国证券、兴业证券、湘财证券、渤海证券、华泰证券、长城证券、东北证券、上海证券、平安证券、东海证券、中信证券、山西证券、东吴证券、东兴证券、万联证券、光大证券、东莞证券、金元证券、中信金通证券、宏源证券、西部证券、江南证券、华安证券、安信证券、财富证券、财通证券、中投证券、万联证券、中山证券、华西证券、红塔证券、厦门证券、华宝证券、国金证券、信达证券、华龙证券、民生证券、广发华福证券、东兴证券等。

## 四、与基金募集有关的当事人

（一）鹏华基金管理有限公司

1名称：鹏华基金管理有限公司
2、法定代表人：何如
3、总经理：邓召明
4、注册资本：人民币1.5亿元
5、注册地址：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
6、批准设立机关及设立批准文号：中国证监会证监基金字［1998］31号
7、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务
8、股权结构：国信证券股份有限公司，持有股份50%%；意大利欧利盛资本资产管理股份公司，持有股份49%；深圳市比蒙投资发展有限公司，持有股份1%。
9、内部组织结构及职能：

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司权力机构，由全体股东组成，决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司设程序明确公司股东通过股东会依法行使权利，不以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会公司的决策机构，对股东会负责，并向股东会汇报。公司董事会由9名董事组成，其中4名为独立董事。根据公司章程的规定，董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权，对公司基本制度的制定权和对总经理等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会，由3名监事组成，其中包括2名职工代表监事。监事会向股东会负责，主要负责检查公司财务开展整个公司监督、高级管理人员履职情况。

公司日常经营管理由总经理负责，公司根据经营需要设置基金管理部、机构投资部、研究部、固定收益部、集中交易室、机构理财部、市场发展部、营销策划部、电子商务部、监察稽核部、登记结算部、国际业务部、产品规划部、信息技术部、总裁办公室、北京、上海、武汉分公司。此外，公司还设有投资决策委员会和信息技术委员会。

10、人员情况：

截至2010年6月底，正式员工200人。其中：博士10人，硕士111人，本科64人，大专9人，高中4人，中专2人。

11、信息披露负责人：程国洪

电话：0755-82021186

12、基金管理业务情况简介：

截至2010年6月30日，鹏华基金管理有限公司旗下共管理14只开放式基金和2只封闭式基金，资产管理规模为470.50亿元。旗下管理的封闭式基金为鹏华普丰（基金代码：184693”）及鹏华普惠（基金代码：184689”），开放式基金有鹏华价值优势股票型证券投资基金（LOF）（基金代码：160617”）、鹏华成长混合型证券投资基金（LOF）（基金代码：160611”）、鹏华盛世创新股票证券投资基金（LOF）（基金代码：160613”）、鹏华沪深300指数型证券投资基金（LOF）（基金代码：160616”）、鹏华精选成长股票型证券投资基金（基金代码：206002”）、鹏华普天收益混合型证券投资基金（基金代码：160603”）、鹏华中国50混合型证券投资基金（基金代码：160605”）、鹏华动力增长混合型证券投资基金（LOF）（基金代码：160610”）、鹏华行业成长混合证券投资基金（基金代码：206001”）、鹏华普天债券型证券投资基金（A类份额代码：160602”，B类份额代码：160608”）、鹏华丰收债券证券投资基金（基金代码：160612”）、鹏华信用增利债券型证券投资基金（A类份额代码：206003”，B类份额代码：206004”）、鹏华货币市场基金（A类份额代码：160606”，B类份额代码：160609”）。

13、本基金基金经理

方南先生，MBA，8年证券从业经验。曾任职于杭州恒生电子股份有限公司，上海新利多数字技术有限公司。2001年11月加盟鹏华基金管理有限公司，历任金融工程部研究员、金融工程部总经理助理、鹏华沪深300指数基金基金经理助理，现同时兼任鹏华中证500指数基金基金经理。

（二）基金托管人情况

1、名称：中国工商银行股份有限公司
2、住所：北京市西城区复兴门内大街55号
3、办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
4、成立时间：1984年1月1日
5、法定代表人：姜建清
6、批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发［1983］146号）
7、注册资本：人民币334,018,850,026元
8、存续期间：持续经营
9、联系人：蒋松云
10、联系电话：021-66105799
11、基金托管部人员情况

截至2010年6月末，中国工商银行资产托管部共有员工121人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

12、基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行着资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至2010年6月，托管证券投资基金165只，其中封闭式9只，开放式156只。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、股权基金、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2010年初，中国工商银行凭借在2009年国内外托管领域的杰出表现和品牌影响力，先后被英国《金融托管人》杂志授予“2009年度中国最佳托管银行”、本届《投资理念》年度大会授予“在亚太地区证券和基金服务领域有突出贡献的年度行业领导者奖项，中国工商银行资产托管常周月秋总经理荣获“年度最佳托管银行家”称号，是仅有的两位获奖人之一。自2004年以来，中国工商银行资产托管服务已经获得23项国内外大奖。

（三）上市推荐人

中银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路171号

办公地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

联系电话：021- 54047892

联系人：曹晖

客户服务电话：021-962505

公司网址：www.sw2000.com.cn

（四）一级交易商

本基金申购赎回代办券商（一级交易商）名单如下：海通证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、万正证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、湘财证券有限责任公司。

（五）验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：陈燕

经办会计师：薛竞、陈燕

## 六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同概要。

## 七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用从基金认购费用中支付，不由基金资产承担。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发行截后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

本基金截至2010年10月22日的资产负债表如下：

| 资产： | 本报告期末 2010年10月22日 |
|---|---|
| 资产： | |
| 银行存款 | 1,258,430.38 |
| 结算备付金 | 5,936,912.39 |
| 存出保证金 | – |
| 交易性金融资产 | 1,112,951,242.13 |
| 其中：股票投资 | 1,112,951,242.13 |
| 债券投资 | – |
| 资产支持证券投资 | – |
| 衍生金融资产 | – |
| 买入返售金融资产 | – |
| 应收证券清算款 | – |
| 应收利息 | 98,911.10 |
| 应收股利 | 13,729.63 |
| 应收申购款 | – |
| 其他资产 | – |
| 资产总计 | 1,120,259,225.63 |
| 负债和所有者权益 | |
| 负债： | |
| 短期借款 | – |
| 交易性金融负债 | – |
| 衍生金融负债 | – |
| 卖出回购金融资产款 | – |
| 应付证券清算款 | – |
| 应付赎回款 | – |
| 应付管理人报酬 | 318,353.11 |
| 应付托管费 | 63,670.63 |
| 应付销售服务费 | – |
| 应付交易费用 | 1,200,033.62 |
| 应交税费 | – |
| 应付利息 | – |
| 应付利润 | – |
| 其他负债 | 209,605.07 |
| 负债合计 | 1,791,662.43 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 1,007,002,863.00 |
| 未分配利润 | 111,464,700.20 |
| 所有者权益合计 | 1,118,467,563.20 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,120,259,225.63 |

注：1、截至2010年10月22日，基金份额净值 1.296元，基金份额总额863,124,067份。

2、本报告期自2010年8月5日起至2010年10月22日止。本基金合同于2010年8月5日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满半年。

## 八、基金投资组合

截至2010年10月22日，本基金的投资组合情况如下：

（一）期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 1,112,951,242.13 | 99.35% |
| | 其中：股票 | 1,112,951,242.13 | 99.35% |
| 2 | 固定收益投资 | – | – |
| | 其中：债券 | – | – |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 3 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 4 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 7,195,342.77 | 0.64% |
| 6 | 其他资产 | 112,640.73 | 0.01% |
| 7 | 资产合计 | 1,120,259,225.63 | 100.00% |

（二）期行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 6,521,670.00 | 0.58 |
| B | 采掘业 | – | – |
| C | 制造业 | 761,311,715.00 | 68.07 |
| C0 | 食品、饮料 | 46,367,708.23 | 4.15 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 79,002,576.02 | 7.06 |
| C2 | 木材、家具 | 11,274,600.00 | 1.01 |
| C3 | 造纸、印刷 | 17,901,329.50 | 1.60 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 99,939,912.48 | 8.94 |
| C5 | 电子 | 30,710,837.61 | 2.75 |
| C6 | 金属、非金属 | 82,140,200.14 | 7.34 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 226,875,298.16 | 20.28 |
| C8 | 医药、生物制品 | 139,246,366.36 | 12.45 |
| C99 | 其他制造业 | 27,852,886.50 | 2.49 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | – | – |
| E | 建筑业 | – | – |
| F | 交通运输、仓储业 | – | – |
| G | 信息技术业 | 36,938,622.39 | 3.30 |
| H | 批发和零售贸易 | 37,372,015.42 | 3.34 |
| I | 金融、保险业 | 152,691,684.78 | 13.65 |
| J | 房地产业 | 85,116,273.41 | 7.61 |
| K | 社会服务业 | – | – |
| L | 传播与文化产业 | – | – |
| M | 综合类 | 32,999,261.13 | 2.95 |
| | 合计 | 1,112,951,242.13 | 99.51 |

（三）期公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600016 | 民生银行 | 25,000,528 | 139,502,946.24 | 12.47 |
| 2 | 600031 | 三一重工 | 4,118,890 | 86,167,178.80 | 7.70 |
| 3 | 600089 | 特变电工 | 4,109,122 | 78,895,142.40 | 7.05 |
| 4 | 600256 | 广汇股份 | 1,515,106 | 56,195,281.54 | 5.02 |
| 5 | 600518 | 康美药业 | 2,411,779 | 43,339,668.53 | 3.87 |
| 6 | 600660 | 福耀玻璃 | 2,858,828 | 38,451,236.60 | 3.44 |
| 7 | 600655 | 豫园商城 | 2,344,543 | 37,372,015.42 | 3.34 |
| 8 | 600276 | 恒瑞医药 | 763,960 | 35,699,850.80 | 3.19 |
| 9 | 600177 | 雅戈尔 | 2,269,990 | 29,055,872.00 | 2.60 |
| 10 | 600196 | 复星医药 | 1,941,450 | 27,665,662.50 | 2.47 |

（四）按券种分类的债券投资组合

截至2010年10月22日，本基金未持有债券。

（五）按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

截至2010年10月22日，本基金未持有债券。

（六）投资组合报告附注

1、自基金合同生效日至2010年10月22日，本基金前十名证券中没有发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

2、本基金前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产构成如下：

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 交易保证金 | – |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收利息 | 98,911.10 |
| 4 | 应收申购款 | – |
| 5 | 应收股利 | 13,729.63 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 112,640.73 |

4、权证投资情况

截至2010年10月22日，本基金未持有权证；自基金合同生效日至2010年10月22日，本基金未投资任何权证。

5、本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至2010年10月22日，本基金未持有可转换债券。

6、本报告期末按市值占基金净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

截至2010年10月22日，本基金未持有资产支持证券。

7、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 九、重大事件揭示

以2010年10月13日为基金份额折算日，本基金进行了基金份额折算，具体内容详见第三章的“三、基金份额折算”。

## 十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，按规定中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）按照法律法规及基金合格产生法定情形时，及时启动基金份额持有人大会召集程序，以保障投资人的合法权益。

（四）如果基金管理人公司发生解散、终止、被撤销、破产等情况，基金管理人将以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，并在中国证监会、证券交易所的监督管理。

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）资格要求（《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产。

（二）根据《基金法》、《证券法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《证券法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

## 十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为中银万国证券股份有限公司。

上市推荐人与本基金管理人、基金托管人之间不存在任何关联关系。

上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：

1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件；

2、基金上市交易实施、准确、完整、符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

## 十三、基金份额的申购与赎回

（一）申购、赎回办理的场所

投资人应当在申购赎回代理券商的营业场所按申购、赎回代理券商提供的方式办理基金的申购和赎回。

目前，基金申购、赎回代办证券公司（一级交易商）包括：海通证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、万正证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、湘财证券有限责任公司。

（二）申购、赎回的开放日和开放时间

1、申购、赎回的开始时间

自2010年10月29日起，本基金开始办理申购、赎回业务。

2、开放日及开放时间

投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为上海证券交易所的交易日，开放时间为：上午9：30—11：30 和下午1：00—3：00。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

若上海证券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、赎回时间进行调整，但此项调整应在实施日前在指定媒体公告。

（三）申购和赎回的原则

1、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。

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、赎回应遵守上交所《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开放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）申购和赎回的数额限定

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变更，并在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定至少在一家指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

（五）申购和赎回的程序

1、申购和赎回的清算

基金投资者必须根据申购赎回代理券商规定的程序，在开放日的业务办理时间向申购赎回代理券商提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须根据申购、赎回清单单据足申购对价；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。否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

2、申购和赎回申请的确认

基金投资者申购、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

本基金申购赎回过程中涉及的股票和基金份额交收适用上海证券交易所和登记结算机构的结算规则。

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份额与组合证券的清算交收。申购、赎回发生的现金替代款和现金差额分别于T+1 日和T+2 日交收，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、基金管理人、申购赎回代理券商之间在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《申购赎回代理券商协议》的有关规定和其他有关法律法规、基金合同及中国证券登记结算有限责任公司《证券登记结算业务实施细则》的有关规定和其他有关约定进行处理。如登记结算机构相关的结算交收规则发生变化，则按最新规定执行。

登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收程序、方式进行调整，并最迟于开始实施前3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

（六）申购、赎回的对价及费用

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。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、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。如遇特殊情况，可以适当延迟编制或公告，并报中国证监会备案。如申购、赎回清单产生差错，基金管理人可申请基金交易所暂停申购、赎回，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申购或赎回份额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。

4、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。

（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+1 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、基金份额净值及其它相关内容。

2、申购赎回清单组合证券相关内容

组合证券是指标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现金替代分为三种类型：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、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×（0+现金替代溢价比例）

其中，数量证券参考价格“四舍五入”确定原则为：

①该证券正常交易时，采用最新成交价；

②该证券正常交易中出现涨停/跌停时，采用涨停/跌停价格；

③该证券停牌且当日有成交时，采用最新成交价；

④该证券停牌且当日无成交时，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。

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 日后被替代的权证没有在正常交易的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权证分证券。

T+2日持续，若已购入金额被替代的证券，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，则认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：

[illegible]

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。

①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。

3、预估现金部分相关内容

预估现金部分是指为便于计算参考基金份额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日预计开盘价相乘之和）

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，当按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 | T日 |
| 基金名称 | 上证民营企业50交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金管理人公司名称 | 鹏华基金管理有限公司 |
| 一级市场基金代码 | 510071 |
| T-1日信息内容 | |
| 现金差额(单位：元) | |
| 最小申购赎回单位资产净值(单位：元) | |
| 基金份额净值(单位：元) | |
| T日信息内容 | |
| 预估现金部分(单位：元) | |
| 现金替代比例上限 | |
| 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 |

T日成份股信息内容

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 600016 | 民生银行 | | 允许 | 10% | |
| 600031 | 三一重工 | | 允许 | 10% | |
| 600067 | 冠城大通 | | 允许 | 10% | |
| 600078 | 澄星股份 | | 允许 | 10% | |
| 600089 | 特变电工 | | 允许 | 10% | |
| 600109 | 国金证券 | | 允许 | 10% | |
| 600110 | 中科英华 | | 允许 | 10% | |
| 600122 | 宏图高科 | | 允许 | 10% | |
| 600143 | 金发科技 | | 允许 | 10% | |
| 600162 | 香江控股 | | 允许 | 10% | |
| 600177 | 雅戈尔 | | 允许 | 10% | |
| 600196 | 复星医药 | | 允许 | 10% | |
| 600208 | 新湖中宝 | | 允许 | 10% | |
| 600210 | 紫江企业 | | 允许 | 10% | |
| 600216 | 浙江医药 | | 允许 | 10% | |
| 600220 | 江苏阳光 | | 允许 | 10% | |
| 600246 | 万通地产 | | 允许 | 10% | |
| 600256 | 广汇股份 | | 允许 | 10% | |
| 600276 | 恒瑞医药 | | 允许 | 10% | |
| 600295 | 鄂尔多斯 | | 允许 | 10% | |
| 600300 | 维维股份 | | 允许 | 10% | |
| 600308 | 华泰股份 | | 允许 | 10% | |
| 600311 | 荣华实业 | | 允许 | 10% | |
| 600331 | 宏达股份 | | 允许 | 10% | |
| 600352 | 浙江龙盛 | | 允许 | 10% | |
| 600380 | 健康元 | | 允许 | 10% | |
| 600408 | 安泰集团 | | 允许 | 10% | |
| 600438 | 通威股份 | | 允许 | 10% | |
| 600439 | 瑞贝卡 | | 允许 | 10% | |
| 600478 | 科力远 | | 允许 | 10% | |
| 600481 | 双良股份 | | 允许 | 10% | |
| 600499 | 科达机电 | | 允许 | 10% | |
| 600516 | 方大炭素 | | 允许 | 10% | |
| 600517 | 置信电气 | | 允许 | 10% | |
| 600518 | 康美药业 | | 允许 | 10% | |
| 600584 | 长电科技 | | 允许 | 10% | |
| 600586 | 金晶科技 | | 允许 | 10% | |
| 600588 | 用友软件 | | 允许 | 10% | |
| 600595 | 中孚实业 | | 允许 | 10% | |
| 600596 | 新安股份 | | 允许 | 10% | |
| 600655 | 豫园商城 | | 允许 | 10% | |
| 600660 | 福耀玻璃 | | 允许 | 10% | |
| 600770 | 综艺股份 | | 允许 | 10% | |
| 600779 | 水井坊 | | 允许 | 10% | |
| 600804 | 鹏博士 | | 允许 | 10% | |
| 600811 | 东方集团 | | 允许 | 10% | |
| 600836 | 界龙实业 | | 允许 | 10% | |
| 600884 | 杉杉股份 | | 允许 | 10% | |
| 600978 | 宜华木业 | | 允许 | 10% | |
| 601877 | 正泰电器 | | 允许 | 10% | |

上述清单格式及内容仅为举例使用，并不构成本基金管理人对信息内容准确性、完整性的保证，亦不构成本基金管理人、基金份额持有人等当事人的权利义务。

（八）申购、赎回的情形及处理方式

除非出现如下情形，基金管理人不得暂停基金投资者的申购、赎回申请：

①不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

②证券交易所《业务细则》在交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；

③上海证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构因异常情况无法办理申购、赎回；

④发生《基金合同》规定的暂停基金资产估值的情形；

⑤申购、赎回清单产生