# 鹏华基金管理有限公司
# 深证民营交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

（上接D9版）

4、基金经理承诺

（1）依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

（2）不得利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

（3）不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

（4）不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（五）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

基金管理人的内部控制遵循以下原则：

（1）健全性原则：内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

（2）有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

（3）独立性原则：公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离；

（4）相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；

（5）成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

2、制订内部控制制度应当遵循以下原则：

（1）合法合规性原则：基金管理人内控制度应当符合国家法律、法规、规章和各项规定；

（2）全面性原则：内部控制制度应当涵盖基金管理人经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞；

（3）审慎性原则：制定内部控制制度应当以审慎经营、防范和化解风险为出发点；

（4）适时性原则：内部控制制度的制定应当随着有关法律法规的调整和基金管理人经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化进行及时的修改或完善。

3、内部控制体系

（1）董事会下设合规与风险控制委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；

（2）公司督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；

（3）公司经营管理层、督察长、监察稽核部、公司各部门总经理定期召开会议对各类风险予以充分的评估和防范，对业务过程中潜在和存在的风险进行通报、讨论，并及时采取防范和控制措施；

（4）监察稽核部负责对基金管理人各部门的风险控制情况进行检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律、法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出整改建议；

（5）业务部门：对本部门业务范围内的业务风险负有管控和及时报告的义务；

（6）风工：依照公司“全面风险管理、全员风险控制”的理念，公司每个员工均负有一线风险控制职责，负责把公司的风险控制理念和措施落实到每一个业务环节当中，并负有把业务过程中发现的风险隐患或风险问题及时进行报告、反馈的义务。

4、内部控制措施

（1）公司通过不断健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，力争从源头上杜绝不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资人利益和公司合法权益；

（2）管理层牢固树立了内控优先的风险管理理念，并着力培养全体员工的风险防范意识，营造浓厚的风险管理文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节；

（3）公司依据自身经营特点建立了包括岗位自控、相关部门和岗位之间相互监督制衡、督察长和监察稽核部监督的、权责统一、严密有效的三道内控防线；

（4）建立并不断完善内部控制体系及内部控制制度；自成立来，公司不断完善内控组织架构、控制程序、控制措施以及控制职责，建立健全内部控制体系。通过不断地对内部控制制度进行修订和更新，公司的内部控制制度不断走向完善；

（5）建立健全各项管理制度和业务规章；公司建立了包括投资管理制度、基金会计制度、信息披露制度、监察稽核制度、信息技术管理制度、公司财务制度等基本管理制度以及包括岗位设置、岗位职责、操作流程手册在内的业务流程、规章等，从基本管理制度和业务流程上进行风险控制；

（6）建立了岗位分离、相互制衡的内控机制；公司在岗位设置上采取了严格的分离制度，实现了基金投资与交易、交易与清算、公司会计与基金会计等业务岗位的分离制度，形成了不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险；

（7）建立健全了岗位责任制；公司通过健全岗位责任制使每位员工都能明确自己的岗位职责和风险管理责任；

（8）构建风险管理系统；公司通过建立风险评估、预警、报告、控制以及监督程序，并经过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警、监督，从而识别、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险，通过明晰的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理、控制，使部门和管理层即时把握风险状况并及时、快速作出风险控制决策；

（9）建立自动化监督控制系统；公司启用了恒生交易系统以及自行开发的投资指标监控系统等计算机辅助控制系统，对投资比例限制、禁止买入股票名单”、交叉交易等方面进行电子化控制，有效地防止了运作风险和操守风险；

（10）不断强化投资纪律，严格实施投票库制度；公司不断强化投资纪律，加强集体决策机制，各基金的行业配置比例、基金经理个股投权、基准仓位等由投资决策委员会决定。同时，公司建立了严格的股票库制度、禁止和限制投资股票制度，并由研究小组负责维护，所有股票投资必须完全从股票库中选择。公司还建立了契约风险评估制度，定期对各基金遵守基金合同的情况进行评估，防范契约风险。

5、基金管理人关于内部合规控制书的声明

（1）基金管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；

（2）基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

（3）基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

## 四、基金托管人

（一）基金托管人情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：郭树清

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字［1998］12号

联系电话：010-67595003

联系人：尹东

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”，中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代码：939）于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股（包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股）。

截至2010年12月31日，中国建设银行实现净利润1350.31亿元，较上年同期增长26.39%。手续费及佣金净收入661.32亿元，较上年同期增长37.61%。年化平均资产回报率为1.32%，年化加权平均净资产收益率为22.61%；净利息收益率为2.49%。信贷资产质量继续稳定向好，不良贷款较上年末实现“双降”，拨备覆盖率大幅提高至221.14%。

中国建设银行在中国内地设有1.3万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、首尔、纽约、胡志明市及悉尼设有分行，在美斯科设有代表处，设立了湖北桃江建信村镇银行、浙江苍南建信村镇银行、安徽繁昌建信村镇银行、浙江青田建信华侨村镇银行、浙江武义建信村镇银行、陕西安塞建信村镇银行、河北丰宁建信村镇银行、上海浦东建信村镇银行、苏州常熟建信村镇银行9家村镇银行，拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建信基金、建信金融租赁、建信信托、中德住房储蓄银行等多家子公司。全行已安装运行自动柜员机（ATM）39,874台，拥有员工313,867万人，为客户提供全面的金融服务。

中国建设银行得到市场和业界的支持和广泛认可，2010年共获得100多个国内外奖项。本集团在英国《银行家》杂志公布的“全球商业银行品牌十强”列第二位，在“全球银行品牌500强”列第13位，并被评为2010年中国最佳银行；在美国《福布斯》杂志公布的“Interbrand 2010年度最佳中国品牌价值排行榜”列第三位，银行业第一位；被《亚洲金融》杂志评为2010年度“中国最佳银行”；连续三年被香港《资本》杂志评为“中国杰出零售银行”；被中国红十字会总会授予“中国红十字杰出奉献奖章”。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队，涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室、团队，现有员工130余人。自2008年以来中国建设银行托管业务持续通过SAS70审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部、长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2011年3月31日，中国建设银行已托管189只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。2010年初，中国建设银行被总部设于英国伦敦的《金球托管人》杂志评为2009年度“国内最佳托管银行”（Domestic Top Rated），并连续第三年被香港《财资》杂志评为“中国最佳次托管银行”。

（四）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管服务部专门设置了监督稽核处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

2、内部控制制度及措施

投资托管服务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，确保业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

（五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，并定期编写基金投资运作监督报告，报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

（1）每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作监督情况，定期编写基金投资运作监督报告，对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格显著性等方面进行评价，报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，并及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、网下现金发售直销机构

（1）鹏华基金管理有限公司直销中心

办公地址：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层

联系电话：0755-82021102

传真：0755-82021155

联系人：梁静

（2）鹏华基金管理有限公司北京分公司

办公地址：北京市西城区金融大街甲9号金融街中心南楼502房

联系电话：010-88082426

传真：010-88082018

联系人：赵晓蔚

（3）鹏华基金管理有限公司上海分公司

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦801B室

联系电话：021-68876878

传真：021-68876821

联系人：李化怡

（4）鹏华基金管理有限公司武汉分公司

办公地址：武汉市江汉区建设大道568号新世界国贸大厦I座4312室

联系电话：027-85557881

传真：027-85557973

联系人：祁明兵

（5）鹏华基金管理有限公司广州分公司

办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路10号富力中心24楼07单元

联系电话：020-38927993

传真：020-38927990

联系人：蔡颖

2、网下现金发售和网下股票发售代理机构

详见基金份额发售公告。

基金管理人可根据有关法律法规要求，根据实情，选择其他符合要求的机构代理发售本基金或变更上述发售代理机构，并及时公告。

3、网上现金发售代理机构

具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位，详见基金份额发售公告。

（二）登记结算机构

中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：金颖

联系电话：0755-25938081

传真：0755-25987132-8081

联系人：赖兴文

（三）律师事务所

北京市金杜律师事务所

住所：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼A座40层

办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼A座40层

负责人：王玲

联系电话：0755-22163333

传真：0755-22163390

联系人：宋萍萍

经办律师：靳庆军、宋萍萍

（四）会计师事务所

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：陈熹

经办会计师：薛竞、陈熹

## 六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》和其他有关法律法规，以及基金合同的规定，经中国证监会2011年6月20日证监许可［2011］969号文核准募集。除法律、行政法规或中国证监会另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得留成或提前发售基金份额。

具体发售方案以本基金的基金份额发售公告为准，请投资人就发售和购买事宜仔细阅读本基金的基金份额发售公告。

（一）基金运作方式和类型

交易型开放式，股票型基金

（二）基金的存续期间

不定期

（三）基金的面值、认购价格

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

（四）募集方式

投资人可以通过网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式认购本基金。

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用深圳证券交易所网上系统以现金进行的认购；网下现金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现金进行的认购；网下股票认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构以股票进行的认购。

投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购的确认以登记结算机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资人可及时查询并妥善行使合法权利。

（五）募集期限

自基金份额发售之日起不超过3个月。

本基金自2011年7月27日起至2011年8月26日止通过销售机构公开发售。其中，网上现金发售期间为2011年7月27日至2011年8月26日，网下现金发售期间为2011年7月27日至2011年8月26日，网下股票认购的发售期间为2011年8月22日至2011年8月26日。基金管理人可根据基金销售情况在募集期限内适当调整上述时间安排并及时公告。

（六）募集对象

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、机构投资者和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人。

（七）募集目标

本基金不设募集目标。

（八）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按基金管理人、发售代理机构提供的其他方式办理基金份额的认购。基金管理人和发售代理机构名单和联系方式见基金份额发售公告。

基金管理人可以根据情况变更、增减发售代理机构，并另行公告。

（九）认购开户

1、投资人认购本基金时需持有深圳证券账户，深圳证券账户是指在中国证券登记结算有限责任公司开设的深圳证券交易所人民币普通股票账户（以下简称“A股账户”）或证券投资基金账户（以下简称“基金账户”）。

（1）已有深圳证券账户的投资人不必再办理开户手续。

（2）拟无深圳证券账户的投资人，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的开户代理机构办理深圳证券账户的开户手续。有关开设深圳证券账户的有关规定、具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询。

2、深圳证券账户使用注意事项

（1）深圳证券账户下的基金账户只能进行基金的网上现金认购及二级市场交易，如投资人需要参与网下股票认购或基金的申购、赎回，则应使用A股账户。

（2）已购买过基金管理人其他开放式基金的投资人，其持有的由基金管理人开立的开放式基金账户不能用于认购本基金。

（十）认购费用

本基金的认购费率最高不超过1%，投资人可以多次认购本基金，认购费率按每笔认购申请单独计算。

本基金认购费率如下表：

| 认购份额 | 认购费率 |
|---|---|
| 50万份以下 | 1.0% |
| 50万份（含）至100万份 | 0.5% |
| 100万份（含）以上 | 每笔1,000元 |

基金认购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

基金管理人办理网下现金认购时，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。

（十一）网上现金认购

1、认购时间：2011年7月27日至2011年8月26日上午9:30-11:30和下午1:00-3:00。投资人在认购期内通过网上现金认购，随到随得。

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、认购手续：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。投资人可多次申报，不可撤单，申报一经确认，认购款项即被冻结。

4、认购金额和利息折算的份额的计算：

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

认购佣金=认购价格×认购份额×佣金比率

认购金额=认购价格×认购份额×（1+佣金比率）

净认购金额=认购价格×认购份额

认购佣金由发售代理机构收取，投资人需以现金方式交纳认购佣金。

网上现金认购款项在基金募集期产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，利息数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=利息认购价格

例：某投资人通过发售代理机构采用网上现金方式认购本基金100,000份，假设该发售代理机构确认的佣金比率为1%，则需准备的资金数额计算如下：

认购佣金=1.00×100,000×1%=1,000元

认购金额=1.00×100,000×（1+1%）=101,000元

净认购金额=1.00×100,000=100,000元

又设该笔资金在募集期间产生了15.8元的利息，则

利息折算的份额=15.8/1.00=15份（保留至整数位）

即，若该投资人通过发售代理机构认购本基金份额100,000份，则需缴纳认购金额101,000元，其中认购佣金1,000元，并可获得利息转换的份额15份。

（十二）网下现金认购

1、认购时间：2011年7月27日至2011年8月26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：网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须在30万份以上（含30万份），超过部分须为1万份的整数倍。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不得撤销。

4、通过基金管理人进行网下现金认购的基金份额的计算：

通过基金管理人进行网下现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购金额的计算公式为：

认购费用=认购价格×认购份额×认购费率

认购金额=认购价格×认购份额×（1+认购费率）

净认购金额=认购价格×认购份额

认购费用由基金管理人收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。

网下现金认购款项在基金募集期产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，利息数额以基金管理人的记录为准。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=利息认购价格

例：某投资人通过基金管理人认购本基金500,000份，认购费率为0.5%，则该投资人的认购金额为：

认购费用=1.00×500,000×0.5%=2,500元

认购金额=1.00×500,000×（1+0.5%）=502,500元

净认购金额=1.00×500,000=500,000元

又设该笔资金在募集期间产生了65.8元的利息，则

利息折算的份额=65.8/1.00=65份（保留至整数位）

即，若该投资人通过基金管理人认购本基金500,000份，则需缴纳认购金额502,500元，其中认购费用2,500元，并可获得利息转换的份额65份。

5、通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算：同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

6、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：2011年8月22日至2011年8月26日。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。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，用以认购的股票必须是深证民营价格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发售代理机构规定的时间之后不得撤销，由发售代理机构对投资人申报的股票进行冻结。

4、特殊情形

①已公告的将被调出深证民营价格指数的成份股不得用于认购本基金。

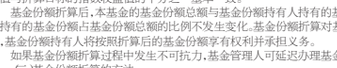
②限制个股认购规模：基金管理人可根据网下股票认购日前3个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购日前至少3个工作日公告限制认购规模的个股名单。认购规模受限的个股一般不超过20只。

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

网下股票认购期内每日日终，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送给基金管理人。本基金发售期最后一日日终，基金管理人初步确认各成份股的有效认购数量。登记结算机构根据基金管理人提供的确认数据，将投资人申请认购的股票过户至本基金证券认购专户，完成验资后划入基金证券账户。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认购金额扣除发行费用后的佣金，并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。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人认购份额的初始登记。

6、认购份额的计算公式：



其中：

①$i$代表投资人提交认购申请的第$i$只股票，如投资人仅提交了1只股票的申请，则$i=1$。

②$N_i$：只股票在网下股票认购期最后一日的均价“由基金管理人根据深圳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，由于该股人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：

1）除息：调整后价格=网下股票认购期最后一日均价-每股现金红利或股息

2）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）

3）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）

4）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）

5）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）

6）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+每股送股比例+每股配股比例）

7）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）

8）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：



其中：

①$i$代表投资人提交认购申请的第$i$只股票，如投资人仅提交了1只股票的申请，则$i=1$。

②$N_i$：只股票在网下股票认购期最后一日的均价“由基金管理人根据深圳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，由于该股人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：

1）除息：调整后价格=网下股票认购期最后一日均价-每股现金红利或股息

2）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）

3）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）

4）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）

5）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）

6）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+每股送股比例+每股配股比例）

7）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）

8）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：



这里$n$为当天可以现金替代的股票只数。

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而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。

本基金T日申购赎回清单中公告预估现金差额计算公式为：

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日经除权调整的前收盘价相乘之和+申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日经除权调整的前收盘价相乘之和）

其中，T日经除权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，则投资人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

申购赎回清单的格式举例如下：

基本信息

| | |
|---|---|
| 最新公告日期 | YYYYMMDD |
| 基金名称 | 民营ETF |
| 基金管理公司名称 | 鹏华基金管理有限公司 |
| 基金代码 | 159911 |
| 拟合指数代码 | 399337 |

T-1日信息内容

| | |
|---|---|
| 现金差额 | XXXX.XX元 |
| 最小申购、赎回单位资产净值 | XXXX.XX元 |
| 基金份额净值 | X.XXXX元 |

T日信息内容

| | |
|---|---|
| 预估现金差额 | XXXX.XX元 |
| 可以现金替代比例上限 | 42% |
| 是否需要公布IOPV | 是 |
| 最小申购、赎回单位 | 500000份 |
| 最小申购赎回单位现金红利 | X.XX元 |
| 申购赎回组合证券只数 | 100只 |
| 是否开放申购 | 允许 |
| 是否开放赎回 | 允许 |
| 是否开放保证金申购 | 禁止 |

组合信息内容

| 证券代码 | 证券简称 | 股份数量 | 现金替代标志 | 现金替代保证金率 | 固定替代金额 |
|---|---|---|---|---|---|
| 000009 | 中国宝安 | | 允许 | 15% | |
| 000046 | 泛海建设 | | 允许 | 15% | |
| 000063 | 中兴通讯 | | 允许 | 15% | |
| 000078 | 海王生物 | | 允许 | 15% | |
| 000159 | 国际实业 | | 允许 | 15% | |
| 000407 | 胜利股份 | | 允许 | 15% | |
| 000418 | 小天鹅A | | 允许 | 15% | |
| 000503 | 海虹控股 | | 允许 | 15% | |
| 000510 | 金路集团 | | 允许 | 15% | |
| 000513 | 丽珠集团 | | 允许 | 15% | |
| 000518 | 四环生物 | | 允许 | 15% | |
| 000527 | 美的电器 | | 允许 | 15% | |
| 000533 | 万家乐 | | 允许 | 15% | |
| 000540 | 中天城投 | | 允许 | 15% | |
| 000559 | 万向钱潮 | | 允许 | 15% | |
| 000566 | 海南海药 | | 允许 | 15% | |
| 000571 | 新大洲A | | 允许 | 15% | |
| 000572 | 海马股份 | | 允许 | 15% | |
| 000616 | 亿城股份 | | 允许 | 15% | |
| 000623 | 吉林敖东 | | 允许 | 15% | |
| 000627 | 天茂集团 | | 允许 | 15% | |
| 000650 | 仁和药业 | | 允许 | 15% | |
| 000667 | 名流置业 | | 允许 | 15% | |
| 000683 | 远兴能源 | | 允许 | 15% | |
| 000690 | 宝新能源 | | 允许 | 15% | |
| 000718 | 苏宁环球 | | 允许 | 15% | |
| 000726 | 鲁泰A | | 允许 | 15% | |
| 000735 | 罗牛山 | | 允许 | 15% | |
| 000752 | 西藏发展 | | 允许 | 15% | |
| 000776 | 广发证券 | | 允许 | 15% | |
| 000783 | 长江证券 | | 允许 | 15% | |
| 000790 | 华神集团 | | 允许 | 15% | |
| 000795 | 太原刚玉 | | 允许 | 15% | |
| 000806 | 银河科技 | | 允许 | 15% | |
| 000816 | 江淮动力 | | 允许 | 15% | |
| 000826 | 桑德环境 | | 允许 | 15% | |
| 000833 | 贵糖股份 | | 允许 | 15% | |
| 000835 | 四川圣达 | | 允许 | 15% | |
| 000848 | 承德露露 | | 允许 | 15% | |
| 000876 | 新希望 | | 允许 | 15% | |
| 000887 | 中鼎股份 | | 允许 | 15% | |
| 000910 | 大亚科技 | | 允许 | 15% | |
| 000926 | 福星股份 | | 允许 | 15% | |
| 000931 | 中关村 | | 允许 | 15% | |
| 000936 | 华西村 | | 允许 | 15% | |
| 000939 | 凯迪电力 | | 允许 | 15% | |
| 000961 | 中南建设 | | 允许 | 15% | |
| 000963 | 华东医药 | | 允许 | 15% | |
| 000989 | 九芝堂 | | 允许 | 15% | |
| 000996 | 中国中期 | | 允许 | 15% | |
| 000997 | 新大陆 | | 允许 | 15% | |
| 000998 | 隆平高科 | | 允许 | 15% | |
| 001696 | 宗申动力 | | 允许 | 15% | |
| 002001 | 新和成 | | 允许 | 15% | |
| 002005 | 德豪润达 | | 允许 | 15% | |
| 002006 | 精功科技 | | 允许 | 15% | |
| 002007 | 华兰生物 | | 允许 | 15% | |
| 002008 | 大族激光 | | 允许 | 15% | |
| 002011 | 盾安环境 | | 允许 | 15% | |
| 002012 | 凯恩股份 | | 允许 | 15% | |
| 002022 | 科华生物 | | 允许 | 15% | |
| 002024 | 苏宁电器 | | 允许 | 15% | |
| 002028 | 思源电气 | | 允许 | 15% | |
| 002029 | 七匹狼 | | 允许 | 15% | |
| 002041 | 登海种业 | | 允许 | 15% | |
| 002048 | 宁波华翔 | | 允许 | 15% | |
| 002056 | 横店东磁 | | 允许 | 15% | |
| 002063 | 远光软件 | | 允许 | 15% | |
| 002064 | 华峰氨纶 | | 允许 | 15% | |
| 002065 | 东华软件 | | 允许 | 15% | |
| 002069 | 獐子岛 | | 允许 | 15% | |
| 002073 | 软控股份 | | 允许 | 15% | |
| 002078 | 太阳纸业 | | 允许 | 15% | |
| 002081 | 金螳螂 | | 允许 | 15% | |
| 002083 | 孚日股份 | | 允许 | 15% | |
| 002097 | 山河智能 | | 允许 | 15% | |
| 002104 | 恒宝股份 | | 允许 | 15% | |
| 002122 | 天马股份 | | 允许 | 15% | |
| 002123 | 荣信股份 | | 允许 | 15% | |
| 002130 | 沃尔核材 | | 允许 | 15% | |
| 002146 | 荣盛发展 | | 允许 | 15% | |
| 002156 | 通富微电 | | 允许 | 15% | |
| 002161 | 远望谷 | | 允许 | 15% | |
| 002167 | 东方锆业 | | 允许 | 15% | |
| 002168 | 深圳惠程 | | 允许 | 15% | |
| 002171 | 精诚铜业 | | 允许 | 15% | |
| 002183 | 怡亚通 | | 允许 | 15% | |
| 002230 | 科大讯飞 | | 允许 | 15% | |
| 002237 | 恒邦股份 | | 允许 | 15% | |
| 002244 | 滨