(上接D9版)

(2)投资决策委员会为公司投资管理的最高决策机构，由公司总经理、副总经理、总经理助理、总监及资深基金经理组成，负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

(3)风险控制委员会为公司风险管理的最高决策机构，由公司总经理、副总经理、督察长、总经理助理以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

(4)督察长积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。

(5)监察稽核部：公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。

(6)业务部门：部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。

(7)岗位员工：公司努力树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，营造一个浓厚的内控文化氛围，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。员工在其岗位职责范围内承担相应的内控责任，并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的义务。

4、内部控制措施

公司确立"制度上控制风险、技术上量化风险"，积极吸收或采用先进的风险控制技术和手段，进行内部控制和风险管理。

(1)公司逐步健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

(2)公司设置的组织结构，充分体现职责明确、相互制约的原则，各部门均有明确的授权分工，操作相互独立。公司逐步建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和反馈系统。

(3)公司设立了顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

① 各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；

② 建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡；

(4)公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备与岗位要求相适应的职业操守和专业胜任能力。

(5)公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

(6)授权控制应当贯穿于公司经营活动的始终，授权控制的主要内容包括：

①股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行；

②公司各部门、分公司及员工在规定授权范围内行使相应的职责；

③重大业务授权采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。

④对已获授权的部门和人员建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

(7)建立完善的基金财务核算与基金资产估值系统和资产分离制度，基金资产与公司自有资产、其他委托资产以及不同基金的资产之间实行独立运作，分别核算，及时、准确和完整地反映基金财产的状况。

(8)建立科学、严格的岗位分离制度，明确划分各岗位职责，投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员的重叠。投资、研究、交易、IT等重要业务部门和岗位进行物理隔离。

(9)建立和维护信息管理系统，严格信息管理，保证客户资料等信息安全、真实和完整。积极维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统，各级领导、部门及员工均有明确的报告途径。

(10)建立和完善客户服务标准，加强基金销售管理，规范基金宣传推介，不得有不正当销售行为和不正当竞争行为。

(11)制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序，对发生严重影响基金份额持有人利益、可能引起系统性风险、严重影响社会稳定的突发事件，按照预案妥善处理。

(12)公司建立健全内部监控制度，督察长、监察稽核部对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实；定期评价内部控制的有效性并适时改进。

①对公司各项制度、业务的合法合规性核查。由监察稽核部设计各部门监察稽核点明细，按照查核项目和查核程序进行部门自查、监察部核查，确保公司各项制度、业务符合有关法律、行政法规、部门规章及行业监管规则。

②对内部风险控制制度的持续监督。由监察稽核部组织相关业务部门、岗位共同识别风险点，界定风险责任人，设计内部风险点自我评估表，对风险点进行评估和分析，并由监察稽核部监督风险控制措施的执行，及时防范和化解风险。

③督察长发现公司存在重大风险或者有违法违规行为，在告知总经理和其他有关高级管理人员的同时，向董事会、中国证监会和公司所在地中国证监会派出机构报告。

5、基金管理人关于内部控制的声明

(1)本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

(2)本公司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)基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间：1984年1月1日
法定代表人：姜建清
注册资本：人民币349,018,545,827元
联系电话：(010)66105799
联系人：赵会军

(二)主要人员情况

截至2011年12月末，中国工商银行资产托管部共有员工145人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

(三)基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承"诚实信用、勤勉尽责"的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2011年12月，中国工商银行共托管证券投资基金231只，其中封闭式7只，开放式224只。自2003年以来，本行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的28项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

(四)基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部"一手抓业务拓展，一手抓内控建设"的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2010年，中国工商银行资产托管部再次通过了评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的国际资格认证SAS70(审计标准第70号)。通过SAS70国际专项认证，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，已经实施SAS70审计年度化、常规化的项目。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门(内控合规部、内部审计局)、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1)合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2)完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3)及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照"内控优先"的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4)审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5)有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6)独立性原则。资产托管部托管的基金资产、托管人的自有资产、托管人托管的其他资产应当分离；直接操作人员和控制人员应相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

(1)严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2)高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3)人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立"自控防线"、"互控防线"、"监控防线"三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立"以人为本"的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4)经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5)内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6)数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7)应急准备与响应。资产托管业务建立了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难应急方案，并组织员工定期演练。除了在数据服务端和应用服务端实时同步备份与数据更新外，资产托管部还建立了操作端的异地备份中心，能够确保交易的及时清算和交割，保证业务不中断。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1)资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2)完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制，横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3)建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4)内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(五)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方案和程序

根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关基金法律法规的规定，对基金的投融资、基金的禁止投资行为、基金的投资范围、投资对象、基金资产的核算、基金资产净值的计算、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、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关基金法律法规规定的行为，基金托管人有权要求基金管理人在规定的期限内进行整改，并且有权向中国证监会报告。基金托管人如果对基金实际投资是否符合有关法律法规的规定及《基金合同》的相关约定存在疑义，应及时向基金管理人提出，基金管理人应及时做出解释、澄清或纠正。

五、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、网下现金发售机构：嘉实基金管理有限公司
名称：嘉实基金管理有限公司
住所：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期23楼01-03单元
办公地址：北京市建国门北大街8号华润大厦8层
法定代表人：安奎
总经理：赵学军
公司网址：www.jsfund.cn

(1)嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址	北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层		
电话	(010)65215588	传真	(010)65215577
联系人	赵虹		

(2)嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期23楼01-03单元		
电话	(021)38789658	传真	(021)68880023
联系人	吴冬梅		

(3)嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址	成都市人民南路一段86号城市之心30H		
电话	(028)86202100	传真	(028)86202100
联系人	胡清泉		

(4)嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址	深圳市深南东路5047号发展银行大厦附楼二楼		
电话	(0755)25870686	传真	(0755)25870663
联系人	周炜		

(5)嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区香港中路10号颐和国际大厦A座3502室		
电话	(0532)66777766	传真	(0532)66777676
联系人	曹涌		

(6)嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市西湖区杭大路15号嘉华国际商务中心313室		
电话	(0571)87759328	传真	(0571)87759331
联系人	徐莉莉		

(7)嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址	福州市鼓楼区五四路158号环球广场25层04单元		
电话	(0591)88013673	传真	(0591)88013670
联系人	吴冬梅		

(8)嘉实基金管理有限公司南京分公司

办公地址	南京市白下区中山东路288号新世纪广场A座4202室		
电话	(025)66671118	传真	(025)66671100
联系人	施镜葵		

(9)嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广州市天河区天河北路183号大都会广场2415-2416室		
电话	(020)87555163	传真	(020)81552120
联系人	庄文胜		

2、网下股票发售代理机构：
详见发售公告。

3、网上现金发售代理机构

投资者可直接通过以下具有基金代销业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务。详见发售公告。

本基金募集期结束前获得基金代销资格的深交所会员可通过深交所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。

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

(二)登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所及办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：金颖
联系人：丁志勇
电话：(0755)25941405
传真：(0755)25987132

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所
住所及办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19层
联系电话：(021)31358666
传真：(021)31358600
负责人：韩炯
联系人：黎明
经办律师：吕红、黎明

(四)审计基金财产的会计师事务所

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：上海卢湾区湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：杨绍信
电话：(021)23238888
传真：(021)23238800
联系人：吴海霞
经办注册会计师：汪棣、吴海霞

六、基金的募集

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他法律法规的相关规定，并经中国证券监督管理委员会2012年1月6日《关于核准中创400交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》(证监许可[2012]13号)核准募集。

(一)基金运作方式和类型

1、基金的类别：股票型

2、基金的运作方式：交易型开放式

(二)基金存续期

不定期

(三)基金份额的募集期、募集方式及场所、募集对象

1、募集期：本基金的募集期为自基金份额发售之日起不超过3个月，具体发售时间见发售公告。

2、募集方式：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3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者通过基金管理人以现金进行的认购；

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的认购。

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。

3、募集场所：

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。

网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购的方式，基金管理人、发售代理机构办理基金发售业务的具体安排和联系方式，详见《招募说明书》和发售公告。

4、募集对象：符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及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。

(四)募集目标

本基金不设定发售规模上限。

(五)基金的认购份额面值、认购价格

本基金每份基金份额初始面值为1.00元，按初始面值发售。

(六)认购开户

1、投资者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者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，需在认购本基金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)如投资者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。如投资者需要参与网下股票认购或本基金的申购、赎回，则应持有并使用深圳A股账户。

(2)已通过二级市场购买过嘉实沪深300指数(LOF)、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实多利分级债券分级份额(包含嘉实多利优先份额及嘉实多利进取份额)、嘉实深证基本面120ETF、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)的投资者，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。

(3)已购买过由嘉实基金管理有限公司其他开放式基金的投资者，其所持有的嘉实基金管理有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。

(七)认购费用

认购费用由投资者承担，认购费率不高于1%，认购费率如下表所示：

认购份额	认购费率
50万份以下	1.0%
50万份以上(含50万份)-100万份以下	0.5%
100万份以上(含100万份)	每笔1000元

基金管理人办理网下现金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、登记结算等募集期间发生的各项费用，不列入基金资产。

(八)网上现金认购

1、认购时间：详见发售公告。

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1000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。

3、认购申请：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。投资者可多次申报，不可撤单，申报一经确认，认购资金即被冻结。

4、认购金额和利息折算的份额的计算

本基金认购金额和利息折算的份额的计算如下：
认购金额=认购价格 ×认购份额 ×(1+佣金比率)
认购佣金=认购价格 ×认购份额 ×佣金比率
利息折算的份额=利息/认购价格

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。

(九)网下现金认购

1、认购时间：详见发售公告。

2、认购限额：网下现金认购以基金份额申请。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)。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

3、认购手续：投资者在认购本基金时，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

本基金认购金额和利息折算的份额的计算如下：
认购金额=认购价格 ×认购份额 ×(1+认购费率)
认购费用=认购价格 ×认购份额 ×认购费率
利息折算的份额=利息/认购价格

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。网下现金认购的利息和具体份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。

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)网下股票认购

1、认购时间：详见发售公告，具体业务办理时间由指定发售代理机构确定。

2、认购限额：

以单只股票股数申报，用以认购的股票必须是中创400指数成份股和已公告的备选成份股。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：

(1)开立并使用深圳A股账户。

(2)在深圳A股账户中具备足够的符合要求的中创400指数成份股和已公告的备选成份股。

(3)投资者填写认购委托单。申报一经确认，认购股票即被冻结。

4、特别提示：投资者应根据法律法规及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。

5、特殊情形

(1)已公告的将被调出中创400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。

(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。

6、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者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。登记结算机构根据基金管理人提供的确认数据，将投资者申请认购的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。基金管理人为投资者计算认购份额，并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，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。

7、认购份额的计算公式：

投资者的认购份额=∑(第i只股票在T日的均价×有效认购数量)/1.00

其中，

(1)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，i≤400。

(2)"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)

(3)"有效认购数量"是指由基金管理人确认的并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：

公式：

q_{max}：限制认购规模的单只个股最高可确认的认购数量；
Cash：网上现金认购和网下现金认购的合计申请数额；
$p_j q_j$：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他个股当日均价和认购申报数量乘积；
w：该股按均价计算的其在网下股票认购日中创400指数中的权重，(认购期间如有中创400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中创400指数编制规则计算调整后的中创400指数构成权重，并以其作为计算依据)；
p：该股在网下股票认购日的均价。

如果投资者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冻结或执行，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者的有效认购数量进行相应调整。

(十一)募集期间认购资金与股票的处理方式

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，归投资者所有；投资者以股票认购的，认购股票由发售代理机构予以冻结，并由登记结算机构于基金募集期结束后过户至预先开立的专门账户，该股票自认购日至划入前述专门账户前产生的孳息归认购投资者本人所有，不划入前述专门账户；在划入前述专门账户前，上述认购股票被强制执行、质押或非交易过户的，认购无效。

七、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，基金募集金额不少于2亿元人民币(含网下股票认购所募集的股票市值)且基金份额持有人不少于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。

(二)《基金合同》不能生效时募集资金的处理方式

如果《基金合同》不能生效，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认购款项，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冻结的股票，应要求发售代理机构予以解冻。

(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5000万元的，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和报送解决方案。

法律法规或中国证监会另有规定时，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《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)基金份额的上市交易

本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》、深交所《业务细则》及其他有关规定。

(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)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、4 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创400指数为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的指数基金，则本基金将本着维护基金份额持有人合法权益的原则，确定是否选取其他合适的指数作为标的指数。

(五)基金份额参考净值(IOPV)的计算与公告

基金管理人在每一交易日开市前向深圳证券交易所提供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，计算并发布基金份额参考净值(IOPV)，供投资者交易、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.基金管理人可以调整基金份额参考净值计算公式，并予以公告。

九、基金份额的申购、赎回

(一)申购和赎回场所

投资者应当在申购赎回代理券商办理基金份额申购、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的申购和赎回。

基金管理人将在开始申购、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，并予以公告。

(二)申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

基金投资者办理基金份额的申购、赎回等业务的开放日为深圳证券交易所的交易日，具体办理时间为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《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，若出现深圳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体上公告。

2、申购与赎回的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、赎回。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，可暂停办理申购。具体业务办理时间在申购赎回开始公告中规定。

基金管理人在申购开始日、赎回开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(三)申购和赎回的数额限制

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300万份，基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整申购与赎回的数额限制，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公告并报中国证监会备案。

(四)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、赎回应遵守深交所《业务细则》的相关规定。

基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但应在新的原则实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上予以公告。

(五)申购和赎回的程序

1、申购和赎回申请的提出

基金投资者必须根据申购、赎回代理券商规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金时须按申购、赎回清单的规定备足申购对价，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。

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。投资者可在申请当日通过其办理申购、赎回的销售网点查询有关申请的确认情况。

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深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的结算规则。

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组合证券的清算交收以及基金份额、现金替代的清算，在T+1日办理基金份额、现金替代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。如果登记结算机构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关于深圳证券交易所上市的交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》及其不时修订的有关规定进行处理。

登记结算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。

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体公告。

(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。

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、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日预估现金差额、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

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：可以现金替代的证券一般是因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保证金率，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，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。

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数据发送给登记结算机构，登记结算机构办理现金替代多退少补资金的清算；T+2日后2个工作日(若在特例情况下，则为T日起第22个交易日)，登记结算机构办理现金替代多退少补资金的交收。

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：

说明：假设当天可以现金替代的股票只数为n。

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

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日收盘价乘积之和)

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

T日申购赎回清单的格式举例如下：

基本信息

最新公告日期：	20120113
基金名称：	中创400
基金管理公司名称：	嘉实基金管理有限公司
基金代码：	159918
标的指数代码：	399624

T-1日信息内容

现金差额：	-21196.19元
最小申购、赎回单位资产净值：	3003013.81元
基金份额净值(单位：元)：	1.001元

T日信息内容

预估现金差额：	-15199.19元
可以现金替代比例上限：	40.00%
是否需要公布IOPV：	是
最小申购、赎回单位：	3000000份
最小申购赎回单位现金红利：	0.00元
申购赎回组合证券只数：	400只
是否开放申购：	允许
是否开放赎回：	允许

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
002009	天奇股份	900	允许	21.00%	
002010	传化股份	1,600	允许	21.00%	
002014	永新股份	600	允许	21.00%	
002015	霞客环保	1,000	允许	21.00%	
002016	世荣兆业	700	允许	21.00%	
002018	华星化工	1,400	允许	21.00%	
002020	京新药业	300	允许	21.00%	
002021	中捷股份	1,800	允许	21.00%	
002026	山东威达	600	允许	21.00%	
002027	七喜控股	700	允许	21.00%	
002031	巨轮股份	1,000	允许	21.00%	
002033	丽江旅游	400	允许	21.00%	
002034	美欣达	300	允许	21.00%	
002035	华帝股份	900	允许	21.00%	
002036	宜科科技	800	允许	21.00%	
002039	黔源电力	500	允许	21.00%	
002040	南京港	500	允许	21.00%	
002042	华孚色纺	1,400	允许	21.00%	
002043	兔宝宝	700	允许	21.00%	
002046	轴研科技	400	允许	21.00%	
002047	成霖股份	1,300	允许	21.00%	
002049	晶源电子	500	允许	21.00%	
002050	三花股份	600	允许	21.00%	
002052	同洲电子	1,400	允许	21.00%	
002053	云南盐化	600	允许	21.00%	
002054	德美化工	800	允许	21.00%	
002055	得润电子	500	允许	21.00%	
002057	中钢天源	300	允许	21.00%	
002058	威尔泰	400	允许	21.00%	
002059	云南旅游	400	允许	21.00%	
002060	粤水电	1,200	允许	21.00%	
002061	江山化工	500	允许	21.00%	
002062	宏润建设	800	允许	21.00%	
002066	瑞泰科技	400	允许	21.00%	
002067	景兴纸业	1,800	允许	21.00%	
002070	众和股份	1,100	允许	21.00%	
002071	江苏宏宝	600	允许	21.00%	
002074	东源电器	1,100	允许	21.00%	
002075	沙钢股份	1,600	允许	21.00%	
002076	雪莱特	600	允许	21.00%	
002077	大港股份	700	允许	21.00%	
002079	苏州固锝	900	允许	21.00%	
002082	栋梁新材	800	允许	21.00%	
002084	海鸥卫浴	700	允许	21.00%	
002085	万丰奥威	700	允许	21.00%	
002087	新野纺织	2,000	允许	21.00%	
002088	鲁阳股份	700	允许	21.00%	
002089	新海宜	1,300	允许	21.00%	
002090	金智科技	500	允许	21.00%	
002094	青岛金王	1,100	允许	21.00%	
002095	生意宝	300	允许	21.00%	
002098	浔兴股份	300	允许	21.00%	
002099	海翔药业	700	允许	21.00%	
002101	广东鸿图	600	允许	21.00%	
002102	冠福家用	1,400	允许	21.00%	
002103	广博股份	400	允许	21.00%	
002105	信隆实业	700	允许	21.00%	
002108	沧州明珠	800	允许	21.00%	
002111	威海广泰	800	允许	21.00%	
002112	三变科技	500	允许	21.00%	
002115	三维通信	600	允许	21.00%	
002116	中国海诚	200	允许	21.00%	
002117	东港股份	300	允许	21.00%	
002118	紫鑫药业	1,200	允许	21.00%	
002119	康强电子	700	允许	21.00%	
002120	新海股份	400	允许	21.00%	
002124	天邦股份	600	允许	21.00%	
002125	湘潭电化	200	允许	21.00%	
002126	银轮股份	500	允许	21.00%	
002127	新民科技	1,000	允许	21.00%	
002131	利欧股份	600	允许	21.00%	
002132	恒星科技	1,400	允许	21.00%	
002133	广宇集团	1,800	允许	21.00%	
002134	天津普林	700	允许	21.00%	
002135	东南网架	500	允许	21.00%	
002137	实益达	600	允许	21.00%	
002138	顺络电子	500	允许	21.00%	
002139	拓邦股份	500	允许	21.00%	
002141	蓉胜超微	600	允许	21.00%	
002144	宏达高科	400	允许	21.00%	
002147	方圆支承	1000	允许	21.00%	
002148	北纬通信	400	允许	21.00%	
002149	西部材料	400	允许	21.00%	
002150	江苏通润	500	允许	21.00%	
002151	北斗星通	300	允许	21.00%	
002157	正邦科技	1,200	允许	21.00%	
002158	汉钟精机	400	允许	21.00%	
002159	三特索道	600	允许	21.00%	
002160	常铝股份	800	允许	21.00%	
002162	斯米克	1,000	允许	21.00%	
002163	中航三鑫	2,200	允许	21.00%	
002164	东力传动	1,100	允许	21.00%	
002165	红宝丽	900	允许	21.00%	
002169	智光电气	1,000	允许	21.00%	
002170	芭田股份	700	允许	21.00%	
002171	精诚铜业	900	允许	21.00%	
002173	山下湖	400	允许	21.00%	
002174	梅花伞	200	允许	21.00%	
002176	江特电机	700	允许	21.00%	
002177	御银股份	1,000	允许	21.00%	
002178	延华智能	400	允许	21.00%	
002180	万力达	300	允许	21.00%	
002181	粤传媒	1,300	允许	21.00%	
002182	云海金属	1,100	允许	21.00%	
002184	海得控制	600	允许	21.00%	
002185	华天科技	1,300	允许	21.00%	
002186	全聚德	400	允许	21.00%	
002187	广百股份	500	允许	21.00%	
002188	新嘉联	500	允许	21.00%	
002189	利达光电	600	允许	21.00%	
002190	成飞集成	400	允许	21.00%	
002191	劲嘉股份	1,200	允许	21.00%	
002192	路翔股份	400	允许	21.00%	
002193	山东如意	400	允许	21.00%	
002194	武汉凡谷	900	允许	21.00%	
002195	海隆软件	300	允许	21.00%	
002197	证通电子	500	允许	21.00%	
002198	嘉应制药	500	允许	21.00%	
002199	东晶电子	300	允许	21.00%	
002201	九鼎新材	500	允许	21.00%	
002203	海亮股份	700	允许	21.00%	
002204	大连重工	300	允许	21.00%	
002205	国统股份	400	允许	21.00%	
002206	海利得	800	允许	21.00%	
002207	准油股份	500	允许	21.00%	
002208	合肥城建	800	允许	21.00%	
002209	达意隆	500	允许	21.00%	
002210	飞马国际	600	允许	21.00%	
002211	宏达新材	1,200	允许	21.00%	
002212	南洋股份	1,100	允许	21.00%	
002213	特尔佳	700	允许	21.00%	
002214	大立科技	400	允许	21.00%	
002215	诺普信	800	允许	21.00%	
002216	三全食品	300	允许	21.00%	
002217	联合化工	900	允许	21.00%	
002218	拓日新能	700	允许	21.00%	
002219	独一味	900	允许	21.00%	
002220	天宝股份	400	允许	21.00%	
002221	东华能源	600	允许	21.00%	
002222	福晶科技	1,000	允许	21.00%	
002226	江南化工	400	允许	21.00%	
002227	奥特迅	200	允许	21.00%	
002228	合兴包装	900	允许	21.00%	
002232	启明信息	900	允许	21.00%	
002234	民和股份	300	允许	21.00%	
002238	天威视讯	600	允许	21.00%	
002240	威华股份	1,400	允许	21.00%	
002243	通产丽星	600	允许	21.00%	
002245	澳洋顺昌	700	允许	21.00%	
002246	北化股份	300	允许	21.00%	
002247	帝龙新材	200	允许	21.00%	
002248	华东数控	800	允许	21.00%	
002250	联化科技	1,200	允许	21.00%	
002251	步步高	500	允许	21.00%	
002252	上海莱士	400	允许	21.00%	
002253	川大智胜	300	允许	21.00%	
002255	海陆重工	500	允许	21.00%	
002256	彩虹精化	600	允许	21.00%	
002258	利尔化学	400	允许	21.00%	
002259	升达林业	1,300	允许	21.00%	
002261	拓维信息	600	允许	21.00%	
002262	恩华药业	400	允许	21.00%	
002263	大东南	1,400	允许	21.00%	
002264	新华都	700	允许	21.00%	
002265	西仪股份	500	允许	21.00%	
002266	浙富股份	800	允许	21.00%	
002267	陕天然气	600	允许	21.00%	
002268	卫士通	500	允许	21.00%	
002271	东方雨虹	800	允许	21.00%	
002273	水晶光电	300	允许	21.00%	
002274	华昌化工	600	允许	21.00%	
002275	桂林三金	800	允许	21.00%	
002276	万马电缆	800	允许	21.00%	
002278	神开股份	700	允许	21.00%	
002281	光迅科技	400	允许	21.00%	
002282	博深工具	400	允许	21.00%	
002283	天润曲轴	1,200	允许	21.00%	
002284	亚太股份	600	允许	21.00%	
002285	世联地产	600	允许	21.00%	
002286	保龄宝	200	允许	21.00%	
002288	超华科技	300	允许	21.00%	
002289	宇顺电子	200	允许	21.00%	
002290	禾盛新材	300	允许	21.00%	
002291	星期六	600	允许	21.00%	
002292	奥飞动漫	600	允许	21.00%	
002293	罗莱家纺	200	允许	21.00%	
002294	信立泰	500	允许	21.00%	
002295	精艺股份	500	允许	21.00%	
002296	辉煌科技	300	允许	21.00%	
002297	博云新材	700	允许	21.00%	
002298	鑫龙电器	400	允许	21.00%	
002300	太阳电缆	700	允许	21.00%	
002301	齐心文具	400	允许	21.00%	
002302	西部建设	400	允许	21.00%	
002303	美盈森	300	允许	21.00%	
002305	南国置业	1,300	允许	21.00%	
002306	湘鄂情	500	允许	21.00%	
002307	北新路桥	1,200	允许	21.00%	
002308	威创股份	1,100	允许	21.00%	
002309	中利科技	600	允许	21.00%	
002311	海大集团	800	允许	21.00%	
002312	三泰电子	400	允许	21.00%	
002313	日海通讯	100	允许	21.00%	
002314	雅致股份	500	允许	21.00%	
002315	焦点科技	200	允许	21.00%	
002316	键桥通讯	700	允许	21.00%	
002317	众生药业	300	允许	21.00%	
002318	久立特材	400	允许	21.00%	
002320	海峡股份	500	允许	21.00%	
002321	华英农业	300	允许	21.00%	
002322	理工监测	200	允许	21.00%	
002324	普利特	600	允许	21.00%	
002325	洪涛股份	500	允许	21.00%	
002326	永太科技	500	允许	21.00%	
002327	富安娜	200	允许	21.00%	
002328	新朋股份	600	允许	21.00%	
002329	皇氏乳业	400	允许	21.00%	
002330	得利斯	400	允许	21.00%	
002332	仙琚制药	1,100	允许	21.00%	
002334	英威腾	200	允许	21.00%	
002335	科华恒盛	300	允许	21.00%	
002336	人人乐	600	允许	21.00%	
002338	奥普光电	200	允许	21.00%	
002339	积成电子	300	允许	21.00%	
002340	格林美	600	允许	21.00%	
002341	新纶科技	300	允许	21.00%	
002342	巨力索具	1,200	允许	21.00%	
002343	禾欣股份	500	允许	21.00%	
002344	海宁皮城	900	允许	21.00%	
002345	潮宏基	400	允许	21.00%	
002349	精华制药	200	允许	21.00%	
002350	北京科锐	300	允许	21.00%	
002351	漫步者	500	允许	21.00%	
002353	杰瑞股份	400	允许	21.00%	
002355	兴民钢圈	500	允许	21.00%	
002358	森源电气	300	允许	21.00%	
002365	永安药业	400	允许	21.00%	
002366	丹甫股份	500	允许	21.00%	
002367	康力电梯	700	允许	21.00%	
002368	太极股份	400	允许	21.00%	
002369	卓翼科技	400	允许	21.00%	
002371	七星电子	100	允许	21.00%	
002372	伟星新材	400	允许	21.00%	
002375	亚厦股份	900	允许	21.00%	
002376	新北洋	500	允许	21.00%	
002378	章源钨业	400	允许	21.00%	
002383	合众思壮	200	允许	21.00%	
002384	东山精密	400	允许	21.00%	
002385	大北农	1000	允许	21.00%	
002386	天原集团	900	允许	21.00%	
002387	黑牛食品	400	允许	21.00%	
002389	南洋科技	200	允许	21.00%	
002390	信邦制药	300	允许	21.00%	
002391	长青股份	300	允许	21.00%	
002392	北京利尔	800	允许	21.00%	
002393	力生制药	400	允许	21.00%	
002394	联发股份	300	允许	21.00%	
002396	星网锐捷	700	允许	21.00%	
002397	梦洁家纺	300	允许	21.00%	
002398	建研集团	200	允许	21.00%	
002400	省广股份	500	允许	21.00%	
002403	爱仕达	600	允许	21.00%	
002406	远东传动	700	允许	21.00%	
002407	多氟多	800	允许	21.00%	
002410	广联达	400	允许	21.00%	
002411	九九久	700	允许	21.00%	
002412	汉森制药	200	允许	21.00%	
002413	常发股份	500	允许	21.00%	
002414	高德红外	500	允许	21.00%	
002416	爱施德	800	允许	21.00%	
002417	三元达	400	允许	21.00%	
002418	康盛股份	700	允许	21.00%	
002419	天虹商场	600	允许	21.00%	
002423	中原特钢	500	允许	21.00%	
002424	贵州百灵	700	允许	21.00%	
002425	凯撒股份	300	允许	21.00%	
002428	云南锗业	400	允许	21.00%	
002429	兆驰股份	1,400	允许	21.00%	
002430	杭氧股份	700	允许	21.00%	
002431	棕榈园林	700	允许	21.00%	
002432	九安医疗	500	允许	21.00%	
002434	万里扬	500	允许	21.00%	
002436	兴森科技	800	允许	21.00%	
002437	誉衡药业	400	允许	21.00%	
002438	江苏神通	200	允许	21.00%	
002439	启明星辰	400	允许	21.00%	
002440	闰土股份	800	允许	21.00%	
002441	众业达	500	允许	21.00%	
002442	龙星化工	500	允许	21.00%	
002444	巨星科技	800	允许	21.00%	
002447	壹桥苗业	300	允许	21.00%	
002449	国星光电	600	允许	21.00%	
002450	康得新	1,000	允许	21.00%	
002454	松芝股份	700	允许	21.00%	
002456	欧菲光	400	允许	21.00%	
002457	青龙管业	600	允许	21.00%	
002459	天业通联	600	允许	21.00%	
002460	赣锋锂业	400	允许	21.00%	
002461	珠江啤酒	500	允许	21.00%	
002463	沪电股份	1,100	允许	21.00%	
002465	海格通信	500	允许	21.00%	
002466	天齐锂业	200	允许	21.00%	
002469	三维工程	200	允许	21.00%	
002470	金正大	600	允许	21.00%	
002475	立讯精密	400	允许	21.00%	
002477	雏鹰农牧	700	允许	21.00%	
002479	富春环保	800	允许	21.00%	
002480	新筑股份	800	允许	21.00%	
002482	广田股份	600	允许	21.00%	
002483	润邦股份	500	允许	21.00%	
002489	浙江永强	400	允许	21.00%	
002490	山东墨龙	400	允许	21.00%	
002496	辉丰股份	300	允许	21.00%	
002497	雅化集团	500	允许	21.00%	
002498	汉缆股份	600	允许	21.00%	
002501	利源铝业	400	允许	21.00%	
002503	搜于特	200	允许	21.00%	
002506	超日太阳	1,500	允许	21.00%	
002508	老板电器	400	允许	21.00%	
002526	山东矿机	700	允许	21.00%	
002527	新时达	400	允许	21.00%	
002532	新界泵业	300	允许	21.00%	
002535	林州重机	600	允许	21.00%	
002539	新都化工	500	允许	21.00%	
002563	森马服饰	400	允许	21.00%	
002570	贝因美	300	允许	21.00%	
002574	明牌珠宝	400	允许	21.00%	
002583	海能达	400	允许	21.00%	
002584	西陇化工	300	允许	21.00%	
002585	双星新材	300	允许	21.00%	
002586	围海股份	200	允许	21.00%	
002588	史丹利	200	允许	21.00%	
002595	豪迈科技	300	允许	21.00%	
300001	特锐德	300	允许	21.00%	
300004	南风股份	400	允许	21.00%	
300005	探路者	700	允许	21.00%	
300006	莱美药业	400	允许	21.00%	
300007	汉威电子	400	允许	21.00%	
300008	上海佳豪	300	允许	21.00%	
300009	安科生物	600	允许	21.00%	
300010	立思辰	600	允许	21.00%	
300012	华测检测	300	允许	21.00%	
300014	亿纬锂能	500	允许	21.00%	
300015	爱尔眼科	700	允许	21.00%	
300017	网宿科技	400	允许	21.00%	
300018	中元华电	400	允许	21.00%	
300020	银江股份	800	允许	21.00%	
300021	大禹节水	700	允许	21.00%	
300022	吉峰农机	1,000	允许	21.00%	
300026	红日药业	300	允许	21.00%	
300028	金亚科技	900	允许	21.00%	
300029	天龙光电	600	允许	21.00%	
300033	同花顺	200	允许	21.00%	
300034	钢研高纳	400	允许	21.00%	
300036	超图软件	400	允许	21.00%	
300037	新宙邦	200	允许	21.00%	
300039	上海凯宝	800	允许	21.00%	
300041	回天胶业	200	允许	21.00%	
300046	台基股份	300	允许	21.00%	
300048	合康变频	400	允许	21.00%	
300050	世纪鼎利	400	允许	21.00%	
300052	中青宝	300	允许	21.00%	
300053	欧比特	500	允许	21.00%	
300054	鼎龙股份	200	允许	21.00%	
300055	万邦达	300	允许	21.00%	
300057	万顺股份	900	允许	21.00%	
300058	蓝色光标	500	允许	21.00%	
300059	东方财富	600	允许	21.00%	
300064	豫金刚石	800	允许	21.00%	
300068	南都电源	800	允许	21.00%	
300072	三聚环保	500	允许	21.00%	

(下转D11版)