

# 关于嘉实沪深 300ETF 开通场内“深市股票实物申赎，沪市股票 现金替代”申赎业务并修改基金合同的公告

为更好地满足投资者需求，根据深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的业务方案，嘉实基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致并报中国证监会备案，决定于 2019 年 10 月 21 日起对旗下嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（场内简称“300ETF”，代码：159919）新增场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎模式，取消原有场内全额现金申赎模式，保留原有场外“股票实物”申赎模式，并对本基金的基金合同和托管协议作相应修改。本基金的场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎模式将于 2019 年 10 月 21 日正式开通，场内全额现金申赎模式将于当日下线。在此期间，本基金的场外“股票实物”申赎业务正常运行。现将相关事项公告如下：

## 一、场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎模式业务规则

在增加了场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎模式并取消了场内全额现金申赎模式后，本基金将有场外“股票实物”和场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”两种申赎模式。其中，场外“股票实物”申赎模式通过中国证券登记结算有限责任公司办理，场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎模式通过深圳证券交易所办理。

本基金将分别编制场外“股票实物”申赎模式的申购赎回清单和场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎模式的申购赎回清单。T 日的申购赎回清单在当日开市前公告。其中，场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎模式的申购赎回清单在深圳证券交易所和基金管理人网站公告，场外“股票实物”申赎模式的申购赎回清单在基金管理人网站公告。

### 1、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基金的申购和赎回业务。

基金管理人在开始办理申购、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。

### 2、申购和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基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所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本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体上公告。

#### （2）申购、赎回开始日及业务办理时间

在确定场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎模式的业务开始时间后，基金管理人应在开始办理申购、赎回前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请且登记结算机构确认接受的，视为投资人在下一开放日提出的申购、赎回申请，并按照下一开放日的申请处理。

### 3、申购与赎回的原则

- (1) 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) 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、赎回应遵守深圳证券交易所、登记结算机构的相关业务规则、通知或指南等规定。

(5) 基金管理人可在不违反法律法规且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，或依据深圳证券交易所或登记结算机构相关规则及其变更调整，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体上公告。

### 4、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，则赎回申请失败。

投资者申购的基金份额当日起可卖出；投资者赎回获得的股票当日起可卖出。

#### (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相关业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定。

投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额与深交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理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。

投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与深交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理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，则依据业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定进行处理。

基金管理人、深圳证券交易所、登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对基金份额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，基金管理人应最迟于新规则开始实施前在指定媒体公告。

### 5、申购和赎回的数量限制

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。

基金管理人可根据基金运作情况、市场变化以及投资者需求等因素在不违反相关法律法规的情况下对基金的最小申购赎回单位进行调整并提前公告。

当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购份额上限、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体规定请参见相关公告。

目前，本基金最小申购赎回单位为 90 万份。基金管理人可根据市场情况、市场变化以及投资者需求等因素，在法律法规允许的情况下，调整申购与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。

#### 6、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、登记结算机构等收取的相关费用。

(3) 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。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、申购赎回清单的计算和公告时间进行调整并提前公告。

#### 7、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申赎现金、组合证券内各成份证券数据、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) 申赎现金

“申赎现金”不属于组合成份证券，是为了便于登记结算机构的清算交收安排，在申购赎回清单中增加的虚拟证券。“申赎现金”的现金替代标志为“必须”，但含义与组合成份证券的必须现金替代不同，“申赎现金”的申购替代金额为最小申购单位所对应的现金替代标志为“必须”的非深市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的非深市成份证券的申购替代金额之和，赎回替代金额为最小赎回单位所对应的现金替代标志为“必须”的非深市成份证券的必须现金替代与现金替代标志为“允许”的非深市成份证券的赎回替代金额之和。

##### (3) 组合证券相关内容

组合证券是指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。

##### (4) 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。

A. 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”）。

对于深市成份证券，现金替代的类型可以设为：“禁止”、“允许”和“必须”。

对于沪市成份证券，可以设为：“允许”和“必须”。

禁止现金替代适用于深交所上市的成份股，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。

可以现金替代适用于所有成份股。

当可以现金替代适用于深交所上市的成份股时，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。

当可以现金替代适用于上交所上市的成份股，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，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。

必须现金替代适用于所有成份股，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。

#### B. 可以现金替代

可以现金替代的组合证券分为：深市成份证券和沪市成份证券。

##### 【1】对于深市成份证券

①适用情形：投资者申购时持仓不足的深市成份证券。登记结算机构先用深市成份证券，不足时差额部分用现金替代。

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）

其中，“该证券参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。如果深圳证券交易所参考价格确定原则发生变化，以深圳证券交易所通知规定的参考价格为准。

收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券正常交易后买入，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，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 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机构和基金托管人，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：

$$\text{现金替代比例}(\%) = \frac{\sum (\text{第 } i \text{ 只替代证券的数量} \times \text{该证券参考价格})}{\text{申购基金份额} \times \text{该 ETF 前一交易日除权除息后的收盘价}} \times 100\%$$

如果深圳证券交易所现金替代比例计算公式发生变化，以深圳证券交易所通知规定的为准。

## 【2】对于沪市成份证券

①适用情形：投资者申购和赎回时的沪市成份证券。登记结构机构对设置可以现金替代的沪市成份证券全部用现金替代。

②替代金额：对于可以现金替代的沪市成份证券，替代金额的计算公式为：

申购替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×（1+现金替代溢价比例）

赎回替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×（1-现金替代折价比例）

其中，“该证券参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。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。

申购时收取现金替代溢价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将买入该证券，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，并据此收取申购替代金额。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。

赎回时扣除现金替代折价的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人将卖出该证券，实际卖出价格扣除相关交易费用后与赎回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折价比例，并据此支付赎回替代金额。如果预先支付的金额低于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将退还少支付的差额；如果预先支付的金额高于基金卖出该部分证券的实际收入，则基金管理人将向投资者收取多支付的差额。

## 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和现金替代折价比例，并据此收取申购替代金额和支付赎回替代金额。

基金管理人将自 T 日起在收到申购交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次买入申购被替代的部分证券，在收到赎回交易确认后按照“时间优先、实时申报”的原则依次卖出赎回被替代的部分证券。T 日未完成的交易，基金管理人在 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）内完成上述交易。

时间优先的原则为：申购赎回方向相同的，先确认成交者优先于后确认成交者。先后顺序按照深交所确认申购赎回的时间确定。

实时申报的原则为：基金管理人在上交所连续竞价期间，根据收到的深交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向上交所申报被替代证券的交易指令。

基金管理人按照“时间优先”的原则依次与申购投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照申购确认时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项；按照“时间优先”的原则依次与赎回投资者确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项，即按照赎回确认时间顺序，以替代金额与被替代证券的依次实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

对于 T 日因停牌或流动性不足等原因未购入和未卖出的被替代部分证券，T 日后基金管理人可以继续与被替代证券的买入和卖出，按照前述原则确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

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，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款

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（包括买入价格与交易费用）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，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项。

T+2 日日终，若已卖出全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项；若未能卖出全部被替代的证券，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照 T+2 日收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。

特例情况：若自 T 日起，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（包括买入价格与交易费用）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，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回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机构和基金托管人，相关款项的清算交收将于此后 3 个工作日内完成。

### C. 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；或处于停牌的成份证券；或因法律法规限制投资的成份证券；或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要设置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该证券参考价格。

#### （5）预估现金差额相关内容

预估现金差额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。

T 日申购赎回清单中公告 T 日预估现金差额。其计算公式为：

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现金替代的固定替代金额之和 + 申购赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与相应证券调整后 T 日开盘参考价相乘之和 + 申购赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与相应证券调整后 T 日开盘参考价相乘之和）

其中，该证券调整后 T 日开盘参考价主要根据中证指数有限公司提供的标的指数成份证券的调整后开盘参考价确定。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。预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。

#### （6）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之和 + 申购赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与相应证券 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相应证券 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**

基金名称:	300ETF
基金管理公司名称:	嘉实基金管理有限公司
基金代码:	159919
目标指数代码:	399300
基金类型:	跨市场 ETF

**T-1 日信息内容**

现金差额:	-1179.27 元
最小申购、赎回单位资产净值:	3514699.55 元
基金份额净值:	3.9052 元

**T 日信息内容**

预估现金差额:	-41324.45 元
可以现金替代比例上限:	50.00%
是否需要公布 IOPV:	是
最小申购、赎回单位:	900000.00 份
最小申购赎回单位现金红利:	0.00 元
全部申购赎回组合证券只数:	301 只(含“159900”证券)
是否开放申购:	允许
是否开放赎回:	允许
当天净申购的基金份额上限:	不设上限
当天净赎回的基金份额上限:	不设上限
单个证券账户当天净申购的基金份额上限:	不设上限
单个证券账户当天净赎回的基金份额上限:	不设上限
当天累计可申购的基金份额上限:	不设上限
当天累计可赎回的基金份额上限:	54000000 份
单个证券账户当天累计可申购的基金份额上限:	不设上限
单个证券账户当天累计可赎回的基金份额上限:	不设上限

**成份股信息内容**

证券代码	证券简称	股份数量	现金替代标志	现金替代溢价比例	现金替代折价比例	申购替代金额	赎回替代金额	挂牌市场
159900	申赎现金	0	必须	0.00%	0.00%	2653522.30	1702969.10	深圳市场
000001	平安银行	2,700	允许	10.00%				深圳市场
000002	万科A	0	必须	0.00%		36708.00	36708.00	深圳市场
000063	中兴通讯	700	允许	10.00%				深圳市场
000069	华侨城A	1,200	允许	10.00%				深圳市场
000100	TCL集团	3,000	允许	10.00%				深圳市场
000157	中联重科	1,400	允许	10.00%				深圳市场
000166	申万宏源	2,500	允许	10.00%				深圳市场
000333	美的集团	1,400	允许	10.00%				深圳市场
000338	潍柴动力	1,400	允许	10.00%				深圳市场
000402	金融街	300	允许	10.00%				深圳市场
000408	藏格控股	200	允许	10.00%				深圳市场
000413	东旭光电	1,200	允许	10.00%				深圳市场
000415	渤海租赁	500	允许	10.00%				深圳市场
000423	东阿阿胶	100	允许	10.00%				深圳市场
000425	徐工机械	1,300	允许	10.00%				深圳市场
000538	云南白药	100	允许	10.00%				深圳市场
000553	安道麦A	100	允许	10.00%				深圳市场
000568	泸州老窖	200	允许	10.00%				深圳市场
000596	古井贡酒	100	允许	10.00%				深圳市场
000625	长安汽车	500	允许	10.00%				深圳市场



000627	天茂集团	600	允许	10.00%				深圳市场
000629	攀钢钒钛	1,200	允许	10.00%				深圳市场
000630	铜陵有色	1,800	允许	10.00%				深圳市场
000651	格力电器	1,400	允许	10.00%				深圳市场
000656	金科股份	600	允许	10.00%				深圳市场
000661	长春高新	100	允许	10.00%				深圳市场
000671	阳光城	500	允许	10.00%				深圳市场
000703	恒逸石化	300	允许	10.00%				深圳市场
000709	河钢股份	1,200	允许	10.00%				深圳市场
000725	京东方A	6,700	允许	10.00%				深圳市场
000728	国元证券	600	允许	10.00%				深圳市场
000768	中航飞机	400	允许	10.00%				深圳市场
000776	广发证券	800	允许	10.00%				深圳市场
000783	长江证券	1,100	允许	10.00%				深圳市场
000786	北新建材	200	允许	10.00%				深圳市场
000858	五粮液	500	允许	10.00%				深圳市场
000876	新希望	600	允许	10.00%				深圳市场
000895	双汇发展	300	允许	10.00%				深圳市场
000898	鞍钢股份	700	允许	10.00%				深圳市场
000938	紫光股份	100	允许	10.00%				深圳市场
000961	中南建设	500	允许	10.00%				深圳市场
000963	华东医药	200	允许	10.00%				深圳市场

001979	招商蛇口	700	允许	10.00%				深圳市场
002001	新和成	400	允许	10.00%				深圳市场
002007	华兰生物	200	允许	10.00%				深圳市场
002008	大族激光	200	允许	10.00%				深圳市场
002010	传化智联	400	允许	10.00%				深圳市场
002024	苏宁易购	1,000	允许	10.00%				深圳市场
002027	分众传媒	2,900	允许	10.00%				深圳市场
002032	苏泊尔	100	允许	10.00%				深圳市场
002044	美年健康	600	允许	10.00%				深圳市场
002050	三花智控	400	允许	10.00%				深圳市场
002065	东华软件	500	允许	10.00%				深圳市场
002081	金螳螂	500	允许	10.00%				深圳市场
002120	韵达股份	100	允许	10.00%				深圳市场
002142	宁波银行	800	允许	10.00%				深圳市场
002146	荣盛发展	500	允许	10.00%				深圳市场
002153	石基信息	100	允许	10.00%				深圳市场
002179	中航光电	100	允许	10.00%				深圳市场
002202	金风科技	800	允许	10.00%				深圳市场
002230	科大讯飞	400	允许	10.00%				深圳市场
002236	大华股份	500	允许	10.00%				深圳市场
002241	歌尔股份	500	允许	10.00%				深圳市场
002252	上海莱士	400	允许	10.00%				深圳市场

002271	东方雨虹	300	允许	10.00%				深圳市场
002294	信立泰	100	允许	10.00%				深圳市场
002304	洋河股份	200	允许	10.00%				深圳市场
002310	东方园林	500	允许	10.00%				深圳市场
002311	海大集团	200	允许	10.00%				深圳市场
002352	顺丰控股	200	允许	10.00%				深圳市场
002410	广联达	200	允许	10.00%				深圳市场
002411	延安必康	100	允许	10.00%				深圳市场
002415	海康威视	1,100	允许	10.00%				深圳市场
002422	科伦药业	200	允许	10.00%				深圳市场
002456	欧菲光	500	允许	10.00%				深圳市场
002460	赣锋锂业	200	允许	10.00%				深圳市场
002466	天齐锂业	200	允许	10.00%				深圳市场
002468	申通快递	100	允许	10.00%				深圳市场
002475	立讯精密	900	允许	10.00%				深圳市场
002493	荣盛石化	400	允许	10.00%				深圳市场
002508	老板电器	100	允许	10.00%				深圳市场
002555	三七互娱	300	允许	10.00%				深圳市场
002558	巨人网络	200	允许	10.00%				深圳市场
002594	比亚迪	300	允许	10.00%				深圳市场
002601	龙蟒佰利	200	允许	10.00%				深圳市场
002602	世纪华通	500	允许	10.00%				深圳市场

002624	完美世界	100	允许	10.00%				深圳市场
002625	光启技术	100	允许	10.00%				深圳市场
002673	西部证券	500	允许	10.00%				深圳市场
002714	牧原股份	200	允许	10.00%				深圳市场
002736	国信证券	700	允许	10.00%				深圳市场
002739	万达电影	200	允许	10.00%				深圳市场
002773	康弘药业	100	允许	10.00%				深圳市场
002925	盈趣科技	100	允许	10.00%				深圳市场
002938	鹏鼎控股	100	允许	10.00%				深圳市场
002939	长城证券	100	允许	10.00%				深圳市场
002945	华林证券	100	允许	10.00%				深圳市场
300003	乐普医疗	300	允许	10.00%				深圳市场
300015	爱尔眼科	300	允许	10.00%				深圳市场
300017	网宿科技	500	允许	10.00%				深圳市场
300024	机器人	300	允许	10.00%				深圳市场
300033	同花顺	100	允许	10.00%				深圳市场
300059	东方财富	1,500	允许	10.00%				深圳市场
300070	碧水源	500	允许	10.00%				深圳市场
300072	三聚环保	300	允许	10.00%				深圳市场
300122	智飞生物	100	允许	10.00%				深圳市场
300124	汇川技术	300	允许	10.00%				深圳市场
300136	信维通信	200	允许	10.00%				深圳市场

300142	沃森生物	300	允许	10.00%				深圳市场
300144	宋城演艺	200	允许	10.00%				深圳市场
300251	光线传媒	200	允许	10.00%				深圳市场
300296	利亚德	500	允许	10.00%				深圳市场
300408	三环集团	300	允许	10.00%				深圳市场
300413	芒果超媒	100	允许	10.00%				深圳市场
300433	蓝思科技	200	允许	10.00%				深圳市场
300498	温氏股份	1,000	允许	10.00%				深圳市场
600000	浦发银行	0	必须	0.00%	0.00%	39501.00	39501.00	上海市场
600004	白云机场	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600009	上海机场	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600010	宝钢股份	5,100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600011	华能国际	1,200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600015	华夏银行	1,700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600016	民生银行	7,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600018	上港集团	900	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600019	宝钢股份	2,500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600023	浙能电力	1,100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600025	华能水电	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600027	华电国际	900	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600028	中国石化	3,800	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600029	南方航空	1,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场

600030	中信 证券	2,200	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600031	三一 重工	1,700	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600036	招商 银行	2,900	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600038	中直 股份	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600048	保利 地产	2,000	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600050	中国 联通	2,600	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600061	国投 资本	500	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600066	宇通 客车	400	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600068	葛洲 坝	800	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600085	同仁 堂	200	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600089	特变 电工	1,000	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600100	同方 股份	700	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600104	上汽 集团	1,000	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600109	国金 证券	700	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600111	北方 稀土	600	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600115	东方 航空	1,300	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600118	中国 卫星	200	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600153	建发 股份	400	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600170	上海 建工	1,300	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600176	中国 巨石	600	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600177	雅戈 尔	1,000	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600188	兖州 煤业	200	允许	10.00%	30.00%			上海 市场

600196	复星医药	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600208	新湖中宝	1,200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600219	南山铝业	2,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600221	海航控股	3,200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600233	圆通速递	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600271	航天信息	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600276	恒瑞医药	900	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600297	广汇汽车	900	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600299	安迪苏	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600309	万华化学	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600332	白云山	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600339	中油工程	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600340	华夏幸福	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600346	恒力石化	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600352	浙江龙盛	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600362	江西铜业	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600369	西南证券	800	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600372	中航电子	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600383	金地集团	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600390	五矿资本	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600398	海澜之家	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600406	国电南瑞	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场

600415	小商品城	800	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600436	片仔癀	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600438	通威股份	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600482	中国动力	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600487	亨通光电	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600489	中金黄金	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600498	烽火通信	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600516	方大炭素	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600519	贵州茅台	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600522	中天科技	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600535	天士力	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600547	山东黄金	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600566	济川药业	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600570	恒生电子	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600583	海油工程	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600585	海螺水泥	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600588	用友网络	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600606	绿地控股	1,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600637	东方明珠	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600660	福耀玻璃	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600663	陆家嘴	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600674	川投能源	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场



600688	上海石化	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600690	海尔智家	1,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600703	三安光电	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600704	物产中大	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600705	中航资本	1,500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600733	北汽蓝谷	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600741	华域汽车	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600760	中航沈飞	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600795	国电电力	3,300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600809	山西汾酒	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600816	安信信托	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600837	海通证券	2,300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600867	通化东宝	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600886	国投电力	1,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600887	伊利股份	1,700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600893	航发动力	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600900	长江电力	1,900	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600919	江苏银行	2,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600926	杭州银行	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600958	东方证券	1,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600977	中国电影	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600998	九州通	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场

600999	招商 证券	800	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601006	大秦 铁路	1,700	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601009	南京 银行	1,700	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601012	隆基 股份	700	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601018	宁波 港	1,100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601021	春秋 航空	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601066	中信 建投	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601088	中国 神华	900	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601108	财通 证券	700	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601111	中国 国航	800	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601117	中国 化学	600	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601138	工业 富联	300	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601155	新城 控股	300	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601162	天风 证券	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601166	兴业 银行	4,100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601169	北京 银行	4,200	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601186	中国 铁建	1,300	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601198	东兴 证券	400	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601211	国泰 君安	1,300	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601212	白银 有色	200	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601216	君正 集团	900	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601225	陕西 煤业	1,100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场

601228	广州港	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601229	上海银行	2,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601238	广汽集团	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601288	农业银行	10,800	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601298	青岛港	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601318	中国平安	3,100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601319	中国人保	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601328	交通银行	7,700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601336	新华保险	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601360	三六零	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601377	兴业证券	1,300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601390	中国中铁	2,300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601398	工商银行	6,100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601555	东吴证券	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601577	长沙银行	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601600	中国铝业	1,800	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601601	中国太保	900	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601607	上海医药	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601618	中国中冶	2,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601628	中国人寿	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601633	长城汽车	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601668	中国建筑	5,900	允许	10.00%	30.00%			上海市场

601669	中国电建	2,200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601688	华泰证券	1,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601727	上海电气	1,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601766	中国中车	2,700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601788	光大证券	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601800	中国交建	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601808	中海油服	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601818	光大银行	4,500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601828	美凯龙	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601838	成都银行	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601857	中国石油	2,300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601877	正泰电器	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601878	浙商证券	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601881	中国银河	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601888	中国国旅	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601898	中煤能源	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601899	紫金矿业	3,400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601901	方正证券	1,200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601919	中远海控	1,100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601933	永辉超市	1,100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601939	建设银行	1,900	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601985	中国核电	1,300	允许	10.00%	30.00%			上海市场

601988	中国 银行	5,900	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601989	中国 重工	2,600	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601992	金隅 集团	900	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601997	贵阳 银行	500	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601998	中信 银行	900	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603019	中科 曙光	200	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603156	养元 饮品	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603160	汇顶 科技	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603259	药明 康德	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603260	合盛 硅业	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603288	海天 味业	200	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603799	华友 钴业	200	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603833	欧派 家居	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603858	步长 制药	200	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603986	兆易 创新	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603993	洛阳 钼业	2,000	允许	10.00%	30.00%			上海 市场

说明：此表仅为示意，以实际公布的为准。

#### 8、拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式

在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资者的申购、赎回申请：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人无法正常运作或无法受理投资者的申购、赎回申请；
- (2) 因特殊原因（包括但不限于相关证券交易场所依法决定临时停市或在交易时间非正常停市）导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- (3) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- (4) 基金管理人开市前因异常情况无法公布申购、赎回清单；
- (5) 相关证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构等因异常情况无法办理申购、赎回，或者指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购、赎回清单无法编制或编制

不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等；

(6) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购或某些申购；

(7) 基金管理人认为可能有损现有基金份额持有人或者其他申购、赎回投资者利益的其他情形；

(8) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取延缓支付赎回对价或暂停接受基金申购赎回申请的措施。

(9) 法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。

发生上述情形之一（第（6）项除外）且基金管理人决定拒绝或暂停基金份额持有人的申购、赎回申请时，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付。在拒绝或暂停申购、赎回的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购、赎回业务的办理并依照《信息披露办法》有关规定在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。

## 二、基金合同、托管协议的修订

因开通场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎业务，我公司就《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）和《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）的相关内容进行了修订。上述修订对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，无需召开基金份额持有人大会。我公司已就修订内容与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并已报中国证监会备案。

本基金《基金合同》和《托管协议》的修订详见附件嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同、托管协议修改前后对照表。

基金管理人将按规定相应更新招募说明书。

## 三、风险揭示

投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的基金合同和招募说明书，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。

## 四、咨询办法

- 1、 嘉实基金管理有限公司客户服务电话:400-600-8800
- 2、 嘉实基金管理有限公司网站:www.jsfund.cn

特此公告

嘉实基金管理有限公司  
2019年10月16日

附件:

1. 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》修改前后对照表
2. 《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》修改前后对照表

附件 1:《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》修改前后对照表

章节	修订前	修订后
八、基金份额的申购、赎回与非交易过户	<p>本基金现采用实物申购赎回和<b>现金申购赎回</b>两种方式。其中，实物申购赎回通过中国证券登记结算有限责任公司办理，<b>现金申购赎回</b>通过深圳证券交易所办理。</p> <p><del>本基金目前只能进行现金申购，暂不开通现金赎回业务。待条件成熟后，本基金可开通现金赎回业务，基金管理人应在开通现金赎回业务前按照规定予以公告。</del></p>	<p>本基金现采用“<u>实物申购赎回</u>”和<b>场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎模式</b>两种方式。其中，实物申购赎回通过中国证券登记结算有限责任公司办理，<b>场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎模式</b>通过深圳证券交易所办理。</p>
	<p>(二) <b>现金</b>申购赎回</p> <p><del>1、现金申赎参与人</del></p> <p><del>可参与本基金现金申购赎回业务的投资者为现金申赎参与人。基金管理人将在开始办理申购赎回业务前公告现金申赎参与人，并可依据实际情况增加、变更现金申赎参与人，并应提前 2 日在指定媒体上予以公告。本基金联接基金可以成为现金申赎参与人。</del></p> <p><del>只有现金申赎参与人可以参与本基金的现金申购赎回。</del></p>	<p>(二) <b>场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”</b>申购赎回</p> <p>删除</p>
	<p>2、申购与赎回的场所</p> <p><del>现金申赎参与人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现金申购和赎回。现金申赎参与人与申购赎回代理券商可以为同一人。</del></p> <p>基金管理人开始办理<b>现金</b>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。</p>	<p>1、申购与赎回的场所</p> <p><b>投资者</b>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的<b>申购和赎回业务</b>。</p> <p>基金管理人开始办理<b>申购、赎回</b>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。</p>
	<p>3、<del>申购与赎回</del><b>办理</b>的开放日及时间</p> <p><del>现金申赎参与人办理基金份额现金申购、赎回等业务的开放日为深圳证券交易所及上海证券交易所的交易日，具体办理时间为深圳证券交易所及上海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本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</del></p> <p>基金合同生效后，若出现<b>相关</b>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，<del>并应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告，</del></p>	<p>2、<del>申购和</del><b>赎回</b>的开放日及时间</p> <p>(1) 开放日及开放时间</p> <p><b>投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回</b>，具体办理时间为<b>上海证券交易所、深圳证券交易所</b>正常交易日的交易时间，<del>但</del>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<b>申购、赎回</b>时除外。</p> <p>基金合同生效后，若出现<b>新的证券交易市场、证券交易所</b>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，<del>但</del>应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在</p>



<p>若证券交易场所依法决定临时停市或在交易时间非正常停市，基金管理人在次日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</p>	<p>指定媒体上公告。</p> <p><u>(2) 申购、赎回开始日及业务办理时间在确定场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”申赎模式的业务开始时间后，基金管理人应在开始办理申购、赎回前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请且登记结算机构确认接受的，视为投资人在下一开放日提出的申购、赎回申请，并按照下一开放日的申请处理。</u></p>
<p>4、申购与赎回的原则</p> <p>(1) <del>本基金采用份额申购、份额赎回的方式，即申购、赎回均以份额申请；</del></p> <p>(2) <del>本基金的现金申购赎回对价为现金替代、现金差额及其他对价；</del></p> <p>(3) <del>本基金</del>申购、赎回申请提交后不得撤销；</p> <p>(4) <del>本基金</del>申购、赎回应遵守深圳证券交易所、登记结算机构的相关业务规则、通知或指南等规定。</p> <p><u>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按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。</u></p> <p><u>具体申购、赎回流程请见招募说明书。</u></p>	<p>3、申购与赎回的原则</p> <p>(1) 基金采用份额申购<u>和</u>份额赎回的方式，即申购<u>和</u>赎回均以份额申请。</p> <p>(2) 基金的申购<u>对价</u>、赎回对价<u>包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。</u></p> <p>(3) 申购、赎回申请提交后不得撤销。</p> <p>(4) 申购、赎回应遵守深圳证券交易所、登记结算机构的相关业务规则、通知或指南等规定。</p> <p><u>(5) 基金管理人可在不违反法律法规且对持有人利益无实质性不利影响的情况下，或依据深圳证券交易所或登记结算机构相关规则及其变更调整，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体上公告。</u></p>
<p>5、申购与赎回的程序</p> <p>(1) 申购<u>与</u>赎回申请的<u>提出</u></p> <p><u>现金申赎参与者</u>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。</p> <p><u>现金申赎参与者在申购本基金</u>时须按申购赎回清单的规定备足申购对价，<u>现金申赎参与者在提交赎回申请时</u>，<u>必须有足够的基金份额余额和现金。</u></p> <p>(2) 申购<u>与</u>赎回申请的<u>确认</u></p> <p><u>对于现金申赎参与者</u>申购、赎回申请在<u>完成交收后进行确认。</u></p> <p><u>如现金申赎参与者未能提供符合要求的申</u></p>	<p>4、申购与赎回的程序</p> <p>(1) 申购<u>和</u>赎回的<u>申请方式</u></p> <p><u>投资人</u>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。</p> <p><u>投资人在提交申购申请</u>时须按申购赎回清单的规定备足申购对价，<u>投资人在提交赎回申请时</u>须持有足够的基金份额余额和现金，<u>否则所提交的申购、赎回申请无效。</u></p> <p>(2) 申购<u>和</u>赎回申请的<u>确认</u></p> <p><u>投资者</u>申购、赎回申请在<u>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</u></p>

<p>购对价，则申购申请失败。如现金申赎参与人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，则赎回申请失败。</p> <p>(3) 申购和赎回的清算交收与登记</p> <p>登记结算机构根据深圳证券交易所现金申购成交数据进行实时逐笔清算，并将清算结果发送参与人。对于日间勾单确认的交易，进行实时交收。交收完成后，登记结算机构将交收结果实时发送参与人（含基金管理人）和深圳证券交易所。对于日间未完成实时逐步全额交收的现金申购，并未进行 T+0 逐笔全额非担保批量交收。</p> <p>在本基金开通现金赎回业务前，基金管理人应根据届时相关证券交易所和登记结算机构相关业务规则公告现金赎回业务的清算交收与登记规则。</p> <p>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，则依据业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定进行处理。</p> <p>基金管理人、登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对<u>上述</u>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，<b>并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一种指定媒体公告。</b></p>	<p>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，则赎回申请失败。</p> <p>投资者申购的基金份额当日起可卖出；投资者赎回获得的股票当日起可卖出。</p> <p>(3) 申购和赎回的清算交收与登记</p> <p><u>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相关业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定。</u></p> <p><u>投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额与深交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理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。</u></p> <p><u>投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与深交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理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。</u></p> <p>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，则依据业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定进行处理。</p> <p>基金管理人、<u>深圳证券交易所</u>、登记结算机构可在法律法规允许的范围内，对<u>基金份额</u>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，<b>基金管理人应最迟于新规则开始实施前在指定媒体公告。</b></p>
<p><b>6、申购和赎回的数量限制</b></p> <p>(1) <b>现金申赎参与人</b>申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。具体规定请参见招募说明书。</p> <p>(2) 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购<b>金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购</b>等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体规定</p>	<p><b>5、申购和赎回的数量限制</b></p> <p>(1) <b>投资人</b>申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。<b>基金管理人可根据基金运作情况、市场变化以及投资者需求等因素在不违反相关法律法规的情况下对基金的最小申购赎回单位进行调整并提前公告。</b>具体规定请参见<b>更新的</b>招募说明书。</p> <p>(2) 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管</p>

<p>请参见相关公告。</p> <p>(3) 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<b>上述规定</b>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体上公告。</p>	<p>理人应当采取设定单一投资者申购<b>份额</b>上限、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益,具体规定请参见相关公告。</p> <p>(3) 基金管理人可以根据市场情况、<b>市场变化以及投资者需求等因素</b>,在法律法规允许的情况下,调整<b>申购和赎回</b>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体上公告<b>并报中国证监会备案</b>。</p>
<p><b>7、申购和赎回的对价、费用及其用途</b></p> <p>(1) <del>本基金的现金申购赎回对价为现金替代、现金差额及其他对价。</del></p> <p><del>(2) 申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和<b>现金申赎参与者</b>申购、赎回的基金份额数额确定。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开市前公告。申购赎回清单的内容与格式见<b>本基金招募说明书</b>。</del></p> <p><del>(3) 现金申赎参与人在申购或赎回基金份额时,申购赎回代理券商可按照一定标准收取佣金。具体规定请参见<b>招募说明书</b>。</del></p>	<p><b>6、申购和赎回的对价、费用及其用途</b></p> <p>(1) <u>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。</u>申购对价、赎回对价根据申购赎回清单和<b>投资者</b>申购、赎回的基金份额数额确定。</p> <p>(2) <u>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一定标准收取佣金,其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用,具体请参见更新的<b>招募说明书</b>。</u></p> <p>(3) <u>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。如遇特殊情况,可以适当延迟计算或公告,并报<b>中国证监会备案</b>。</u>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<b>深圳证券交易所</b>开市前公告。<u>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<b>基金份额净值、申购赎回清单</b>的计算和公告时间进行调整并提前公告。</u></p>
<p><b>8、拒绝或暂停<b>现金</b>申购的情形及处理方式</b> <del>本基金暂不开通<b>现金赎回</b>业务。</del>在如下情况下,基金管理人可以拒绝或暂停接受<b>现金申赎参与人的现金申购</b>申请:</p> <p>(1) 因不可抗力导致基金管理人无法正常运作或无法受理<b>现金申赎参与人的现金</b>申购;</p> <p>(4) 基金管理人开市前因异常情况无法公布申购赎回清单;</p> <p>(5) 相关证券交易所、申购赎回代理券商、</p>	<p><b>7、拒绝或暂停<b>申购、赎回</b>的情形及处理方式</b></p> <p>在如下情况下,基金管理人可以拒绝或暂停接受<b>投资者的申购、赎回</b>申请:</p> <p>(1) 因不可抗力导致基金管理人无法正常运作或无法受理<b>投资者的申购、赎回</b>申请;</p> <p>(4) 基金管理人开市前因异常情况无法公布<b>申购、赎回</b>清单;</p> <p>(5) 相关证券交易所、申购赎回代理券商、登记结算机构等因异常情况无法办理申</p>

<p>登记结算机构等因异常情况无法办理<b>现金</b>申购，或者指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等；</p> <p>(6) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔<b>现金</b>申购或某些<b>现金</b>申购；</p> <p>(8) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。</p> <p>发生上述情形之一（第（6）项除外）且基金管理人决定拒绝或暂停现金申赎参与人的<b>现金</b>申购申请时，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。在拒绝或暂停<b>现金</b>申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复<b>现金</b>申购业务的办理并依照《信息披露办法》有关规定在指定媒体上刊登基金重新开放<b>现金</b>申购公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。</p>	<p><b>购、赎回</b>，或者指数编制单位、相关证券交易所等因异常情况使申购、赎回清单无法编制或编制不当。上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等；</p> <p>(6) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购或某些申购；</p> <p>(8) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当采取<b>延缓支付赎回对价或暂停接受基金申购赎回</b>申请的措施。</p> <p><b><u>在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购和赎回可能同时暂停。</u></b></p> <p>发生上述情形之一（第（6）项除外）且基金管理人决定拒绝或暂停基金份额持有人的<b>申购、赎回</b>申请时，基金管理人应当在当日向中国证监会备案，并及时公告。<b><u>已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付。</u></b>在拒绝或暂停<b>申购、赎回</b>的情形消除时，基金管理人应及时恢复<b>申购、赎回</b>业务的办理并依照《信息披露办法》有关规定在指定媒体上刊登基金重新开放<b>申购或赎回</b>公告，并公告最近 1 个开放日的基金份额净值。</p>
---	--

附件 2:《嘉实沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》修改前后对照表

章节	修订前	修订后
五、基金资产的保管	<p>(四)基金进行定期存款投资的账户开设和管理</p> <p><del>基金托管人根据基金管理人的指令</del>以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户,并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。<del>基金管理人应派专人协助办理开户事宜。</del>在上述账户开立和账户相关信息变更过程中,基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料,并对基金托管人给予积极配合和协助。</p>	<p>(四)基金进行定期存款投资的账户开设和管理</p> <p><u>基金管理人</u>以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户,<u>基金托管人</u>负责该账户银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中,基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。</p>
	<p>(七)债券托管专户的开设和管理</p> <p>基金合同生效后,基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格,并代表基金进行交易;基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户,并代表基金进行银行间债券市场和资金的清算。<del>在上述手续办理完毕之后,由基金托管人负责向中国人民银行报备。</del></p>	<p>(七)债券托管专户的开设和管理</p> <p>基金合同生效后,基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格,并代表基金进行交易;<u>由基金管理人负责向中国人民银行报备,在上述手续办理完毕之后</u>,基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司<u>和银行间市场清算所股份有限公司</u>开设银行间债券市场债券托管账户,并代表基金进行银行间债券市场和资金的清算。</p>
七、交易及清算交收安排	<p>(四)申购、赎回的清算交收和数据传递的时间和程序</p> <p>3、本基金现采用实物申购赎回和<u>现金申购赎回</u>两种方式。其中,实物申购赎回通过中国证券登记结算有限责任公司办理,<u>现金申购赎回</u>通过深圳证券交易所办理。<del>本基金目前只能进行现金申购,暂不开通现金赎回业务。待条件成熟后,本基金可开通现金赎回业务,基金管理人应在开通现金赎回业务前按照规定予以公告。</del></p> <p>5、<del>现金申购的清算交收方式如下:登记结算机构根据深圳证券交易所现金申购成交数据进行实时逐笔清算,并将清算结果发送结算参与人。对于日间勾单确认的交易,进行实时交收。交收完成后,登记结算机构将交收结果实时发送参与人(含基金管理人)和深圳证券交易所。对于日间未完成实时逐笔全额交收的现金申购,日未进行 T+0 逐笔全额非担保批量交收。现金差额的清算于 T+1 日办理,基金托管人根据登记结算机构的结算通知或基金管</del></p>	<p>(四)申购、赎回的清算交收和数据传递的时间和程序</p> <p>3、本基金现采用实物申购赎回和<u>场内“深市股票实物申赎,沪市股票现金替代”申赎模式</u>两种方式。其中,实物申购赎回通过中国证券登记结算有限责任公司办理,<u>场内“深市股票实物申赎,沪市股票现金替代”申赎模式</u>通过深圳证券交易所办理。</p> <p>5、<u>场内“深市股票实物申赎,沪市股票现金替代”申赎模式</u>的清算交收方式如下:<u>T 日的申购赎回发生的证券交收由证券登记结算机构在 T 日收市后完成,基金托管人应在 T+1 日开盘前核对登记结算机构发送的证券余额。基金托管人在 T+1 日办理申购和赎回的现金替代的交收。</u>基金托管人根据登记结算机构的结算通知或基金管理人的指令,依据登记结算机构的最新规则于 T+2 日起办理现金差额和现金替代退补款的交收,<u>如果登记结算机构相关的结算交</u></p>

<p>理人的指令,依据登记结算机构的最新规则于 T+2 日起办理现金差额和现金替代退补款的交收。</p> <p><del>在本基金开通现金赎回业务前,基金管理人应根据届时相关证券交易所和登记结算机构相关业务规则公告现金赎回业务的清算交收与登记规则。</del></p> <p>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,则依据业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定进行处理。</p>	<p><u>收业务规则发生变更,则按最新规则办理。基金管理人和基金托管人也可经协商一致后,在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内,采取其他可行的交收方式。</u>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,则依据业务规则和参与各方相关协议及其不时修订的有关规定进行处理。</p>
--	--