

关于嘉实中证 500ETF 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建设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 日起对旗下嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（场内简称“500ETF”，代码：159922）新增场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”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，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。

（一）申购与赎回的场所

投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理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。

（二）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。

（三）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。

（四）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的登记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至少一种指定媒体公告。

（五）申购和赎回的数量限制

1. 投资人申购、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。目前，本基金最小申购赎回单位为 45 万份。

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。

3. 基金管理人可以根据市场情况、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,调整申购和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体上公告并报中国证监会备案。

(六) 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。

(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。

(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”)。

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。

(2) 可以现金替代

【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的 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进行的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。

（3）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：

$$T \text{ 日预估现金差额} = T-1 \text{ 日最小申购赎回单位的基金资产净值} - (\text{申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额之和} + \text{申购赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与相应证券调整后 T 日开盘参考价相乘之和} + \text{申购赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与相应证券调整后 T 日开盘参考价相乘之和})$$

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：

$$T \text{ 日现金差额} = T \text{ 日最小申购赎回单位的基金资产净值} - (\text{申购赎回清单中必须现金替代的固定替代金额之和} + \text{申购赎回清单中可以现金替代成份证券的数量与相应证券 T 日收盘价相乘之和} + \text{申购赎回清单中禁止现金替代成份证券的数量与相应证券 T 日收盘价相乘之和})$$

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：	500ETF
基金管理公司名称：	嘉实基金管理有限公司
基金代码：	159922
目标指数代码：	399905
基金类型：	跨市场 ETF

T-1 日信息内容

现金差额：	-19073.19 元
最小申购、赎回单位资产净值：	2358921.25 元
基金份额净值：	5.2402 元

T 日信息内容

预估现金差额：	-34060.75 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：	450000.00 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：	501 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：	45000000 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%	1248047.00	795039.00	深圳市场
000006	深振业A	600	允许	10.00%				深圳市场
000008	神州高铁	0	必须	0.00%		4164.00	4164.00	深圳市场
000009	中国宝安	1,600	允许	10.00%				深圳市场
000012	南玻A	800	允许	10.00%				深圳市场
000021	深科技	500	允许	10.00%				深圳市场
000025	特力A	100	允许	10.00%				深圳市场
000027	深圳能源	700	允许	10.00%				深圳市场
000028	国药一致	100	允许	10.00%				深圳市场
000031	大悦城	700	允许	10.00%				深圳市场
000039	中集集团	700	允许	10.00%				深圳市场
000060	中金岭南	1,500	允许	10.00%				深圳市场
000061	农产品	400	允许	10.00%				深圳市场
000062	深圳华强	200	允许	10.00%				深圳市场
000066	中国长城	1,100	允许	10.00%				深圳市场
000078	海王生物	1,000	允许	10.00%				深圳市场
000089	深圳机场	600	允许	10.00%				深圳市场
000090	天健集团	800	允许	10.00%				深圳市场
000156	华数传媒	400	允许	10.00%				深圳市场
000158	常山北明	600	允许	10.00%				深圳市场
000301	东方盛虹	700	允许	10.00%				深圳市场

000400	许继电气	400	允许	10.00%				深圳市场
000401	冀东水泥	600	允许	10.00%				深圳市场
000426	兴业矿业	500	允许	10.00%				深圳市场
000488	晨鸣纸业	800	允许	10.00%				深圳市场
000501	鄂武商 A	200	允许	10.00%				深圳市场
000513	丽珠集团	200	允许	10.00%				深圳市场
000519	中兵红箭	400	允许	10.00%				深圳市场
000528	柳工	600	允许	10.00%				深圳市场
000536	华映科技	900	允许	10.00%				深圳市场
000537	广宇发展	300	允许	10.00%				深圳市场
000541	佛山照明	400	允许	10.00%				深圳市场
000543	皖能电力	700	允许	10.00%				深圳市场
000547	航天发展	700	允许	10.00%				深圳市场
000552	靖远煤电	700	允许	10.00%				深圳市场
000559	万向钱潮	800	允许	10.00%				深圳市场
000563	陕国投 A	1,200	允许	10.00%				深圳市场
000564	供销大集	1,100	允许	10.00%				深圳市场
000581	威孚高科	400	允许	10.00%				深圳市场
000587	金洲慈航	700	允许	10.00%				深圳市场
000598	兴蓉环境	1,100	允许	10.00%				深圳市场
000600	建投能源	400	允许	10.00%				深圳市场
000623	吉林敖东	600	允许	10.00%				深圳市场

000636	风华高科	400	允许	10.00%				深圳市场
000681	视觉中国	300	允许	10.00%				深圳市场
000685	中山公用	500	允许	10.00%				深圳市场
000686	东北证券	900	允许	10.00%				深圳市场
000690	宝新能源	1,100	允许	10.00%				深圳市场
000712	锦龙股份	300	允许	10.00%				深圳市场
000717	韶钢松山	700	允许	10.00%				深圳市场
000718	苏宁环球	900	允许	10.00%				深圳市场
000723	美锦能源	800	允许	10.00%				深圳市场
000727	华东科技	1,700	允许	10.00%				深圳市场
000729	燕京啤酒	900	允许	10.00%				深圳市场
000732	泰禾集团	600	允许	10.00%				深圳市场
000738	航发控制	400	允许	10.00%				深圳市场
000750	国海证券	1,800	允许	10.00%				深圳市场
000758	中色股份	800	允许	10.00%				深圳市场
000761	本钢板材	200	允许	10.00%				深圳市场
000766	通化金马	300	允许	10.00%				深圳市场
000778	新兴铸管	1,700	允许	10.00%				深圳市场
000807	云铝股份	1,000	允许	10.00%				深圳市场
000813	德展健康	600	允许	10.00%				深圳市场
000826	启迪环境	400	允许	10.00%				深圳市场
000829	天音控股	400	允许	10.00%				深圳市场

000830	鲁西化工	600	允许	10.00%				深圳市场
000848	承德露露	400	允许	10.00%				深圳市场
000860	顺鑫农业	300	允许	10.00%				深圳市场
000869	张裕A	100	允许	10.00%				深圳市场
000877	天山股份	400	允许	10.00%				深圳市场
000878	云南铜业	500	允许	10.00%				深圳市场
000883	湖北能源	1,200	允许	10.00%				深圳市场
000887	中鼎股份	500	允许	10.00%				深圳市场
000926	福星股份	500	允许	10.00%				深圳市场
000930	中粮科技	700	允许	10.00%				深圳市场
000932	华菱钢铁	1,000	允许	10.00%				深圳市场
000937	冀中能源	700	允许	10.00%				深圳市场
000959	首钢股份	1,000	允许	10.00%				深圳市场
000960	锡业股份	600	允许	10.00%				深圳市场
000970	中科三环	500	允许	10.00%				深圳市场
000975	银泰资源	700	允许	10.00%				深圳市场
000980	众泰汽车	700	允许	10.00%				深圳市场
000983	西山煤电	1,000	允许	10.00%				深圳市场
000987	越秀金控	200	允许	10.00%				深圳市场
000988	华工科技	500	允许	10.00%				深圳市场
000990	诚志股份	200	允许	10.00%				深圳市场
000997	新大陆	400	允许	10.00%				深圳市场

000998	隆平 高科	600	允许	10.00%				深圳 市场
000999	华润 三九	200	允许	10.00%				深圳 市场
002002	鸿达 兴业	1,000	允许	10.00%				深圳 市场
002004	华邦 健康	1,000	允许	10.00%				深圳 市场
002019	亿帆 医药	400	允许	10.00%				深圳 市场
002028	思源 电气	300	允许	10.00%				深圳 市场
002030	达安 基因	300	允许	10.00%				深圳 市场
002038	双鹭 药业	400	允许	10.00%				深圳 市场
002048	宁波 华翔	300	允许	10.00%				深圳 市场
002049	紫光 国微	300	允许	10.00%				深圳 市场
002051	中工 国际	300	允许	10.00%				深圳 市场
002056	横店 东磁	500	允许	10.00%				深圳 市场
002064	华峰 氨纶	700	允许	10.00%				深圳 市场
002074	国轩 高科	500	允许	10.00%				深圳 市场
002075	沙钢 股份	1,100	允许	10.00%				深圳 市场
002078	太阳 纸业	1,000	允许	10.00%				深圳 市场
002085	万丰 奥威	800	允许	10.00%				深圳 市场
002092	中泰 化学	900	允许	10.00%				深圳 市场
002093	国脉 科技	300	允许	10.00%				深圳 市场
002110	三钢 闽光	600	允许	10.00%				深圳 市场
002118	紫鑫 药业	300	允许	10.00%				深圳 市场
002127	南极 电商	900	允许	10.00%				深圳 市场

002128	露天煤业	400	允许	10.00%				深圳市场
002129	中环股份	1,000	允许	10.00%				深圳市场
002131	利欧股份	2,900	允许	10.00%				深圳市场
002152	广电运通	700	允许	10.00%				深圳市场
002155	湖南黄金	500	允许	10.00%				深圳市场
002157	正邦科技	700	允许	10.00%				深圳市场
002174	游族网络	300	允许	10.00%				深圳市场
002176	江特电机	700	允许	10.00%				深圳市场
002183	怡亚通	900	允许	10.00%				深圳市场
002191	劲嘉股份	500	允许	10.00%				深圳市场
002195	二三四五	2,800	允许	10.00%				深圳市场
002212	南洋股份	300	允许	10.00%				深圳市场
002217	合力泰	1,100	允许	10.00%				深圳市场
002221	东华能源	700	允许	10.00%				深圳市场
002223	鱼跃医疗	400	允许	10.00%				深圳市场
002233	塔牌集团	400	允许	10.00%				深圳市场
002242	九阳股份	200	允许	10.00%				深圳市场
002244	滨江集团	1,000	允许	10.00%				深圳市场
002249	大洋电机	700	允许	10.00%				深圳市场
002250	联化科技	500	允许	10.00%				深圳市场
002251	步步高	300	允许	10.00%				深圳市场
002254	泰和新材	300	允许	10.00%				深圳市场

002266	浙富控股	1,000	允许	10.00%				深圳市场
002268	卫士通	400	允许	10.00%				深圳市场
002273	水晶光电	700	允许	10.00%				深圳市场
002280	联络互动	900	允许	10.00%				深圳市场
002281	光迅科技	200	允许	10.00%				深圳市场
002285	世联行	800	允许	10.00%				深圳市场
002299	圣农发展	300	允许	10.00%				深圳市场
002302	西部建设	300	允许	10.00%				深圳市场
002317	众生药业	400	允许	10.00%				深圳市场
002332	仙琚制药	500	允许	10.00%				深圳市场
002340	格林美	2,000	允许	10.00%				深圳市场
002344	海宁皮城	400	允许	10.00%				深圳市场
002353	杰瑞股份	300	允许	10.00%				深圳市场
002358	森源电气	300	允许	10.00%				深圳市场
002366	台海核电	300	允许	10.00%				深圳市场
002368	太极股份	200	允许	10.00%				深圳市场
002371	北方华创	100	允许	10.00%				深圳市场
002372	伟星新材	400	允许	10.00%				深圳市场
002373	千方科技	500	允许	10.00%				深圳市场
002375	亚厦股份	400	允许	10.00%				深圳市场
002382	蓝帆医疗	200	允许	10.00%				深圳市场
002384	东山精密	600	允许	10.00%				深圳市场

002385	大北农	1,600	允许	10.00%				深圳市场
002387	维信诺	500	允许	10.00%				深圳市场
002390	信邦制药	600	允许	10.00%				深圳市场
002399	海普瑞	200	允许	10.00%				深圳市场
002405	四维图新	1,000	允许	10.00%				深圳市场
002407	多氟多	300	允许	10.00%				深圳市场
002408	齐翔腾达	500	允许	10.00%				深圳市场
002414	高德红外	200	允许	10.00%				深圳市场
002416	爱施德	200	允许	10.00%				深圳市场
002419	天虹股份	300	允许	10.00%				深圳市场
002424	贵州百灵	300	允许	10.00%				深圳市场
002426	胜利精密	1,500	允许	10.00%				深圳市场
002431	棕榈股份	700	允许	10.00%				深圳市场
002434	万里扬	300	允许	10.00%				深圳市场
002437	誉衡药业	500	允许	10.00%				深圳市场
002439	启明星辰	400	允许	10.00%				深圳市场
002440	闰土股份	400	允许	10.00%				深圳市场
002444	巨星科技	300	允许	10.00%				深圳市场
002463	沪电股份	700	允许	10.00%				深圳市场
002465	海格通信	1,000	允许	10.00%				深圳市场
002470	金正大	1,000	允许	10.00%				深圳市场
002482	广田集团	400	允许	10.00%				深圳市场

002489	浙江永强	700	允许	10.00%				深圳市场
002491	通鼎互联	500	允许	10.00%				深圳市场
002500	山西证券	1,000	允许	10.00%				深圳市场
002503	搜于特	900	允许	10.00%				深圳市场
002505	大康农业	1,700	允许	10.00%				深圳市场
002506	协鑫集成	1,600	允许	10.00%				深圳市场
002507	涪陵榨菜	300	允许	10.00%				深圳市场
002509	天广中茂	1,100	允许	10.00%				深圳市场
002512	达华智能	500	允许	10.00%				深圳市场
002517	恺英网络	700	允许	10.00%				深圳市场
002544	杰赛科技	200	允许	10.00%				深圳市场
002572	索菲亚	400	允许	10.00%				深圳市场
002573	清新环境	400	允许	10.00%				深圳市场
002583	海能达	600	允许	10.00%				深圳市场
002589	瑞康医药	700	允许	10.00%				深圳市场
002603	以岭药业	400	允许	10.00%				深圳市场
002607	中公教育	400	允许	10.00%				深圳市场
002635	安洁科技	200	允许	10.00%				深圳市场
002640	跨境通	500	允许	10.00%				深圳市场
002665	首航节能	1,100	允许	10.00%				深圳市场
002670	国盛金控	500	允许	10.00%				深圳市场
002672	东江环保	300	允许	10.00%				深圳市场

002681	奋达科技	500	允许	10.00%				深圳市场
002690	美亚光电	200	允许	10.00%				深圳市场
002699	美盛文化	200	允许	10.00%				深圳市场
002701	奥瑞金	900	允许	10.00%				深圳市场
002707	众信旅游	400	允许	10.00%				深圳市场
002709	天赐材料	200	允许	10.00%				深圳市场
002745	木林森	200	允许	10.00%				深圳市场
002797	第一创业	1,300	允许	10.00%				深圳市场
002807	江阴银行	700	允许	10.00%				深圳市场
002812	恩捷股份	100	允许	10.00%				深圳市场
002815	崇达技术	200	允许	10.00%				深圳市场
002818	富森美	100	允许	10.00%				深圳市场
002821	凯莱英	100	允许	10.00%				深圳市场
002831	裕同科技	200	允许	10.00%				深圳市场
002839	张家港行	600	允许	10.00%				深圳市场
002916	深南电路	100	允许	10.00%				深圳市场
002920	德赛西威	100	允许	10.00%				深圳市场
002926	华西证券	800	允许	10.00%				深圳市场
002936	郑州银行	400	允许	10.00%				深圳市场
002941	新疆交建	100	允许	10.00%				深圳市场
002946	新乳业	100	允许	10.00%				深圳市场
002948	青岛银行	300	允许	10.00%				深圳市场

300001	特锐德	300	允许	10.00%				深圳市场
300002	神州泰岳	1,000	允许	10.00%				深圳市场
300009	安科生物	400	允许	10.00%				深圳市场
300010	立思辰	400	允许	10.00%				深圳市场
300026	红日药业	1,100	允许	10.00%				深圳市场
300027	华谊兄弟	1,200	允许	10.00%				深圳市场
300055	万邦达	400	允许	10.00%				深圳市场
300058	蓝色光标	1,100	允许	10.00%				深圳市场
300088	长信科技	1,100	允许	10.00%				深圳市场
300113	顺网科技	300	允许	10.00%				深圳市场
300115	长盈精密	300	允许	10.00%				深圳市场
300133	华策影视	700	允许	10.00%				深圳市场
300134	大富科技	200	允许	10.00%				深圳市场
300159	新研股份	600	允许	10.00%				深圳市场
300166	东方国信	500	允许	10.00%				深圳市场
300168	万达信息	500	允许	10.00%				深圳市场
300182	捷成股份	1,100	允许	10.00%				深圳市场
300197	铁汉生态	1,000	允许	10.00%				深圳市场
300199	翰宇药业	300	允许	10.00%				深圳市场
300207	欣旺达	500	允许	10.00%				深圳市场
300244	迪安诊断	200	允许	10.00%				深圳市场
300253	卫宁健康	800	允许	10.00%				深圳市场

300257	开山股份	200	允许	10.00%				深圳市场
300266	兴源环境	600	允许	10.00%				深圳市场
300274	阳光电源	600	允许	10.00%				深圳市场
300287	飞利信	700	允许	10.00%				深圳市场
300297	蓝盾股份	500	允许	10.00%				深圳市场
300308	中际旭创	100	允许	10.00%				深圳市场
300315	掌趣科技	1,700	允许	10.00%				深圳市场
300316	晶盛机电	400	允许	10.00%				深圳市场
300324	旋极信息	600	允许	10.00%				深圳市场
300376	易事特	600	允许	10.00%				深圳市场
300383	光环新网	600	允许	10.00%				深圳市场
300418	昆仑万维	400	允许	10.00%				深圳市场
300450	先导智能	300	允许	10.00%				深圳市场
300459	金科文化	700	允许	10.00%				深圳市场
600006	东风汽车	0	必须	0.00%	0.00%	2275.00	2275.00	上海市场
600008	首创股份	1,400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600017	日照港	1,100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600021	上海电力	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600022	山东钢铁	4,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600026	中远海能	800	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600037	歌华有线	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600039	四川路桥	1,300	允许	10.00%	30.00%			上海市场

600053	九鼎投资	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600056	中国医药	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600058	五矿发展	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600060	海信电器	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600062	华润双鹤	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600064	南京高科	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600073	上海梅林	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600079	人福医药	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600094	大名城	1,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600098	广州发展	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600120	浙江东方	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600125	铁龙物流	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600126	杭钢股份	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600138	中青旅	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600141	兴发集团	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600143	金发科技	1,200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600151	航天机电	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600155	华创阳安	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600158	中体产业	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600160	巨化股份	800	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600161	天坛生物	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600166	福田汽车	2,900	允许	10.00%	30.00%			上海市场

600167	联美控股	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600169	太原重工	1,100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600171	上海贝岭	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600179	ST 安通	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600183	生益科技	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600195	中牧股份	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600201	生物股份	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600216	浙江医药	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600258	首旅酒店	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600259	广晟有色	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600260	凯乐科技	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600266	北京城建	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600267	海正药业	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600277	亿利洁能	800	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600280	中央商场	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600282	南钢股份	1,600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600291	西水股份	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600298	安琪酵母	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600307	酒钢宏兴	1,900	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600312	平高电气	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600315	上海家化	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600316	洪都航空	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场

600317	营口港	1,200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600325	华发股份	1,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600329	中新药业	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600335	国机汽车	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600338	西藏珠峰	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600348	阳泉煤业	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600350	山东高速	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600373	中文传媒	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600376	首开股份	800	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600380	健康元	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600388	龙净环保	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600392	盛和资源	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600393	粤泰股份	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600409	三友化工	800	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600410	华胜天成	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600416	湘电股份	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600418	江淮汽车	800	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600426	华鲁恒升	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600428	中远海特	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600435	北方导航	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600458	时代新材	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600460	士兰微	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场

600466	蓝光发展	900	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600478	科力远	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600486	扬农化工	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600497	驰宏锌锗	1,600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600499	科达洁能	800	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600500	中化国际	800	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600507	方大特钢	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600511	国药股份	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600515	海航基础	1,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600521	华海药业	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600525	长园集团	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600528	中铁工业	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600536	中国软件	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600545	卓郎智能	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600549	厦门钨业	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600557	康缘药业	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600563	法拉电子	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600565	迪马股份	900	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600567	山鹰纸业	2,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600572	康恩贝	1,100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600575	淮河能源	1,200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600580	卧龙电驱	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场

600582	天地科技	1,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600584	长电科技	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600597	光明乳业	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600598	北大荒	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600611	大众交通	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600623	华谊集团	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600633	浙数文化	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600639	浦东金桥	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600640	号百控股	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600642	申能股份	1,500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600643	爱建集团	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600645	中源协和	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600648	外高桥	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600649	城投控股	800	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600657	信达地产	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600664	哈药股份	900	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600673	东阳光	900	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600694	大商股份	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600699	均胜电子	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600707	彩虹股份	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600717	天津港	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600718	东软集团	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场

600729	重庆百货	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600737	中粮糖业	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600739	辽宁成大	800	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600745	闻泰科技	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600748	上实发展	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600750	江中药业	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600751	海航科技	1,100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600754	锦江酒店	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600755	厦门国贸	800	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600757	长江传媒	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600759	洲际油气	1,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600763	通策医疗	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600765	中航重机	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600770	综艺股份	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600777	新潮能源	2,100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600779	水井坊	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600782	新钢股份	1,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600787	中储股份	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600801	华新水泥	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600804	鹏博士	900	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600808	马钢股份	1,800	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600811	东方集团	1,800	允许	10.00%	30.00%			上海市场

600820	隧道股份	1,200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600823	世茂股份	900	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600827	百联股份	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600835	上海机电	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600839	四川长虹	2,300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600845	宝信软件	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600848	上海临港	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600859	王府井	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600862	中航高科	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600863	内蒙华电	1,800	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600869	智慧能源	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600872	中炬高新	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600874	创业环保	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600875	东方电气	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600879	航天电子	1,300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600881	亚泰集团	2,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600884	杉杉股份	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600885	宏发股份	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600895	张江高科	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600901	江苏租赁	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600903	贵州燃气	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
600908	无锡银行	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场

600909	华安 证券	1,100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600917	重庆 燃气	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600939	重庆 建工	300	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600959	江苏 有线	1,500	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600967	内蒙 一机	500	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600970	中材 国际	600	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600971	恒源 煤电	400	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600978	宜华 生活	700	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600985	淮北 矿业	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600993	马应 龙	200	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
600996	贵广 网络	200	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601000	唐山 港	1,800	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601001	大同 煤业	500	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601003	柳钢 股份	300	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601005	重庆 钢铁	3,600	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601016	节能 风电	1,000	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601019	山东 出版	400	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601068	中铝 国际	200	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601098	中南 传媒	400	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601100	恒立 液压	200	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601106	中国 一重	1,700	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601118	海南 橡胶	1,100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场

601127	小康股份	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601128	常熟银行	1,000	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601139	深圳燃气	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601168	西部矿业	1,200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601179	中国西电	1,300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601200	上海环境	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601231	环旭电子	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601311	骆驼股份	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601326	秦港股份	900	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601333	广深铁路	2,100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601608	中信重工	1,100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601611	中国核建	500	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601615	明阳智能	200	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601678	滨化股份	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601689	拓普集团	300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601699	潞安环能	700	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601717	郑煤机	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601718	际华集团	1,300	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601777	力帆股份	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601801	皖新传媒	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601811	新华文轩	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
601866	中远海发	2,400	允许	10.00%	30.00%			上海市场

601869	长飞 光纤	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601872	招商 轮船	1,500	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601880	大连 港	1,900	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601928	凤凰 传媒	500	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601958	金钼 股份	600	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601966	玲珑 轮胎	300	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
601969	海南 矿业	200	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603000	人民 网	300	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603025	大豪 科技	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603056	德邦 股份	200	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603077	和邦 生物	3,300	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603198	迎驾 贡酒	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603225	新凤 鸣	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603228	景旺 电子	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603233	大参 林	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603328	依顿 电子	200	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603355	莱克 电气	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603369	今世 缘	300	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603377	东方 时尚	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603444	吉比 特	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603486	科沃 斯	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场
603501	韦尔 股份	100	允许	10.00%	30.00%			上海 市场

603515	欧普照明	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
603517	绝味食品	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
603556	海兴电力	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
603568	伟明环保	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
603569	长久物流	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
603650	彤程新材	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
603659	璞泰来	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
603712	七一二	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
603766	隆鑫通用	600	允许	10.00%	30.00%			上海市场
603806	福斯特	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
603816	顾家家居	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
603866	桃李面包	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
603868	飞科电器	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
603877	太平鸟	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
603883	老百姓	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
603885	吉祥航空	400	允许	10.00%	30.00%			上海市场
603888	新华网	100	允许	10.00%	30.00%			上海市场
603939	益丰药房	100	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。

(八)拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式

发生下列情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购、赎回申请：

1. 因不可抗力导致基金无法正常运作或无法受理投资人的申购、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. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

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、赎回投资人利益的其他情形。

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《嘉实中证 500 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《嘉实中证 500 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建设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》的修改详见附件嘉实中证 500 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. 《嘉实中证 500 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. 《嘉实中证 500 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:《嘉实中证 500 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	《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》	《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》 (修订后)
八、基金份额的申购、赎回与非交易过户	<p>(一) 申购和赎回场所</p> <p>投资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申购和赎回。</p> <p>基金管理人在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单, 并可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商, 并予以公告。</p> <p>投资人可以通过基金管理人直销中心办理基金申购、赎回业务, 具体业务的办理时间及办理方式基金管理人将另行公告。</p>	<p>本基金现采用“实物申购赎回”和场内“深市股票实物申赎, 沪市股票现金替代”申赎模式两种方式。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, 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。</p> <p>一、实物申购赎回</p> <p>(一) 申购和赎回场所</p> <p>投资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申购和赎回。</p> <p>基金管理人在开始申购、赎回业务前公告申购赎回代理券商的名单, 并可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商, 并予以公告。</p> <p>投资人可以通过基金管理人直销中心办理基金申购、赎回业务, 具体业务的办理时间及办理方式基金管理人将另行公告。</p>
八、基金份额的申购、赎回与非交易过户		<p>增加以下内容:</p> <p>二、场内“深市股票实物申赎, 沪市股票现金替代”申购赎回</p> <p>(一) 申购与赎回的场所</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(二) 申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1. 开放日及开放时间</p> <p>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。</p> <p>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</p>

		<p>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。</p> <p>2. 申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(三) 申购与赎回的原则</p> <ol style="list-style-type: none"> 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。 <p>(四) 申购与赎回的程序</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 申购和赎回的申请方式 <p>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。</p> <p>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。</p> <ol style="list-style-type: none"> 2. 申购和赎回申请的确认 <p>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。</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> <ol style="list-style-type: none"> 3. 申购和赎回的清算交收与登记
--	--	---

		<p>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。</p> <p>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的登记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。</p> <p>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。</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、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开始实施前 3 个工作日在至少一种指定媒体公告。</p> <p>(五) 申购和赎回的数量限制</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 投资人申购、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。具体规定请参见招募说明书。 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。 3. 基金管理人可以根据市场情况、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, 调整申购和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体上公告并报中国证监会备案。 <p>(六) 申购和赎回的对价、费用及其用途</p> <ol style="list-style-type: none"> 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
--	--	---

		<p>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。</p> <p>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，具体请参见招募说明书。</p> <p>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。</p> <p>(七) 拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式</p> <p>发生下列情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购、赎回申请：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 因不可抗力导致基金无法正常运作或无法受理投资人的申购、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. 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。 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、赎回投资人利益的其他情形。 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中国证监会认定的其他情形。 <p>在发生暂停申购或赎回的情形之一时，本基金的申购</p>
--	--	---

		<p>和赎回可能同时暂停。</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申购、赎回申请时，基金管理人应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。</p>
--	--	--

附件 2:《嘉实中证 500 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	《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》	《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》 (修订后)
七、交易及清算交收安排	(三) 基金申购和赎回业务处理的基本规定	(三) 基金申购和赎回业务处理的基本规定 增加以下内容: 3. 本基金现采用实物申购赎回和场内“深市股票实物申赎, 沪市股票现金替代”申赎模式两种方式。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, 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。
七、交易及清算交收安排	(三) 基金申购和赎回业务处理的基本规定 3. 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+1 日收市后完成, 基金托管人应在 T+2 日开盘前核对登记结算机构发送的证券余额。现金替代和现金差额的清算于 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 日起办理现金替代、现金差额和现金替代退补款的交收, 如果登记结算机构相关的结算交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。	(三) 基金申购和赎回业务处理的基本规定 4. 实物申购赎回的清算交收方式如下: 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+1 日收市后完成, 基金托管人应在 T+2 日开盘前核对登记结算机构发送的证券余额。现金替代和现金差额的清算于 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 日起办理现金替代、现金差额和现金替代退补款的交收, 如果登记结算机构相关的结算交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。
七、交易及清算交收安排		(三) 基金申购和赎回业务处理的基本规定 增加以下内容: 5. 场内“深市股票实物申赎, 沪市股票现金替代”申赎模式的清算交收方式如下: 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。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

		<p>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，如果登记结算机构相关的结算交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。</p>
--	--	---