

关于国联安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资 基金开通场外实物申购、赎回业务的公告

为了更好地满足投资者需求，根据《国联安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《国联安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则，国联安基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）经与基金托管人国泰君安证券股份有限公司协商一致，决定于2021年9月3日起对旗下国联安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”；基金扩位简称：证券ETF基金；基金代码：159848）新增场外实物申购赎回业务，保留原有场内申赎模式，并对本基金的招募说明书作相应更新。本基金的场外实物申购赎回业务将于2021年9月3日正式开通，在此期间，本基金的场内申购赎回业务正常运行。现将相关事项公告如下：

一、场外实物申购赎回业务规则

在增加了场外实物申购赎回模式后，本基金将有“场外实物申购赎回”和“场内申购赎回”两种方式。其中，场外实物申购赎回通过中国证券登记结算有限责任公司办理，场内申购赎回通过深圳证券交易所办理。

本基金将分别编制场外实物申购赎回清单和场内申购赎回清单。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，场外实物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份额的申购与赎回。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，并可根据情况变更或增减基金申购赎回代理券商，并在基金管理人网站公示。

（二）申购和赎回的开放日及时间

投资者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、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中

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。开放日的具体业务办理时间见招募说明书或相关公告。

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、登记结算机构的业务规则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》的有关规定在规定媒介上公告。

（三）申购与赎回的原则

- 1、本基金采用份额申购和份额赎回的原则，即申购和赎回均以份额申请。
- 2、本基金申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。
- 3、本基金申购、赎回申请提交后不得撤销。
- 4、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。
- 5、本基金申购赎回应遵守业务规则及其他有关的规定。

基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益、不违背深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司相关规则的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

（四）申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

投资者须按申购赎回代理券商规定的程序，在开放日的开放时间提出申购、赎回的申请。投资者申购本基金时，须根据申购、赎回清单备足相应数量的股票和现金，否则申购不成立；投资者交付申购对价，申购成立；登记结算机构确认基金份额时，申购生效。投资者提交赎回申请时，必须持有足够的基金份额余额和现金，否则赎回不成立；登记结算机构确认赎回时，赎回生效。

2、申购和赎回申请的确认

基金投资者申购、赎回申请在T+1 日进行确认。

对于投资人提交的申购申请，申购赎回代理券商根据投资人提交的申购申请以及T 日基金管理人公布的申购赎回清单，相应冻结投资人账户内的组合证券、

现金替代款和预估现金差额。T+1 日，基金管理人根据冻结情况符合要求的申购申请予以确认。如冻结情况不符合要求，则申购申请失败。

对于投资人提交的赎回申请，申购赎回代理券商根据投资人提交的赎回申请以及T 日基金管理人公布的申购赎回清单，相应冻结投资人账户内的基金份额、预估现金差额。T+1 日，基金管理人根据冻结情况对投资人的赎回申请予以确认。如投资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。

投资人应在T+2 日后及时通过其办理申购、赎回的销售网点查询有关申请的确认情况。投资人应及时查询有关申请的确认情况。

销售机构对申购、赎回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该申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

基金管理人在不违反法律法规的前提下，可对上述程序规则进行调整。基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

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《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定。

T+1 日，登记机构根据基金管理人根据申购、赎回申请的确认信息，为投资者办理组合证券、基金份额的清算交收，并将结果发送给相关证券交易所、申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。通常情况下，投资者T 日申购所得的基金份额、赎回所得的组合证券在T+2 日可用。现金替代和现金差额由基金管理人与申购赎回代理券商于T+1 日进行清算，T+2 日进行交收，登记机构可以依据相关规则对此提供代收代付服务并完成交收。对于确认失败的申请，登记机构将对冻结的组合证券和基金份额予以解冻，申购赎回代理券商将对冻结的资金予以解冻。

如果登记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《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》、《中国证券登记结

算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》和参与各方相关协议的有关规定进行处理。

投资者应按照本基金合同和招募说明书的约定和申购赎回代理券商的规定按时足额支付应付的现金差额、现金替代和现金替代退补款。因投资者原因导致现金差额、现金替代和现金替代退补款未能按时足额交收的，基金管理人有权为基金的利益向该投资者追偿并要求其承担由此导致的其他基金份额持有人或基金资产的损失。

若投资者用以申购的部分或全部组合证券或者用以赎回的部分或全部基金份额因被国家有权机关冻结或强制执行导致不足额的，基金管理人有权指示申购赎回代理券商及登记机构依法进行相应处置；如该情况导致其他基金份额持有人或基金资产遭受损失的，基金管理人有权代表其他基金份额持有人或基金资产要求该投资者进行赔偿。

如深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司修改或更新上述规则并适用于本基金的，则按照新的规则执行。

基金管理人和登记机构可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质性利益的前提下，对上述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，并按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上予以公告。

（五）申购与赎回的数量限制

1、投资人申购、赎回的基金份额需以最小申购、赎回单位的整数倍进行申报，最小申购、赎回单位由基金管理人确定和调整。本基金最小申购、赎回单位为 500,000份。

2、基金管理人可根据市场情况，合理调整申购和赎回份额等数量限制，以对当日的申购总规模或赎回总规模进行控制，并在申购、赎回清单中公告。

3、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或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体规定请参见相关公告。

4、基金管理人可根据基金运作情况、市场情况以及投资者需求等因素，在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购和赎回等限制，或者新增基金规模控制措施。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（六）申购与赎回的对价

1、申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给基金份额持有人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。申购对价、赎回对价根据申购、赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。

2、申购、赎回清单由基金管理人编制。T日的申购、赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告。

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。

4、本基金份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。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，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

5、基金管理人可以在不违反相关法律法规且对基金份额持有人无实质性不利影响的情况下对申购对价、赎回对价组成、基金份额净值、申购、赎回清单计算和公告时间或频率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、赎回单位所对应的组合证券、申赎现金、现金替代、T日预估现金部分、T-1日的现金差额、基金份额净值及其他相关内容。

2、组合证券相关内容

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规定的原则，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。

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，现金替代的类型可以设为：“允许”和“必须”。

禁止现金替代适用于深圳证券交易所上市的成份股，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证券，对于深市成份证券，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；对于沪市成份证券，可以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，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证券，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。

（1）可以现金替代

1) 适用情形：出于证券停牌等原因导致投资人无法在申购时买入证券或基金管理人认为可以适用的其他情形。

2) 替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额=替代证券数量×该证券参考价格×（1+现金替代保证金率）

其中，该证券参考价格目前为该证券前一交易日除权后的收盘价。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。

收取现金替代保证金的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在该部分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买入该部分

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买入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资人收取欠缺的差额。

3) 替代金额的处理程序如下：

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+1日后被替代的部分证券有正常交易的2个交易日（即T+3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+3日日终，若基金管理人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买入成本（包括买入价格和交易费用）的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项；若基金管理人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的实际买入成本加上按照T+3日收盘价计算的未购入部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资人或投资人应补交的款项。

特殊情况：若自T+1日起，相关证券交易所正常交易日已达20日而该部分证券的正常交易日低于2日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券的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人或投资人应补交的款项。

T+3日后的第1个市场交易日（在特殊情况下则为T+1日起的第21个市场交易日），基金管理人将应退款和应补款的明细及汇总数据发送给相关申购赎回代理券商和基金托管人，相关款项的清算交收，将在T+3日后2个市场交易日（在特殊情况下则为T+1日起的第22个市场交易日）内完成，登记机构对此提供代收代付服务。

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人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：

$$\text{现金替代比例}(\%) = \frac{\sum \text{第 } i \text{ 只替代证券的数量} \times \text{该证券经除权调整的T-1日收盘价}}{\text{申购基金份额} \times \text{T-1日基金份额净值}} \times 100\%$$

(2) 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；或出于保护基金持有人利益等目的基金管理人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，为便于计算基金份额参考净值及申购赎回代理券商预先冻结申请申购、赎回的投资人的相应资金，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：

$$T日预估现金差额 = T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值 - (申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日经除权调整后的开盘参考价乘积之和 + 申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日经除权调整后的开盘参考价乘积之和)$$

其中，T日经除权调整后的开盘参考价主要根据中证指数公司所提供的标的指数成份证券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”需要扣减相应的收益分配数额。

预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。

5、现金差额相关内容

T日现金差额在T+1日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：

$$T日现金差额 = T日最小申购赎回单位的基金资产净值 - (申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额 + 申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日收盘价乘积之和 + 申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日收盘价乘积之和)$$

T日投资人申购、赎回基金份额时，需按T+1日公告的T日现金差额进行资金的清算交收。现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资人申购时，如现金差额为正数，则投资人应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资人将根据其申购的基金份额获得相应的现金；在投资人赎回时，如现金差额为正数，则投资人将根据其赎回的基金份额获得相应的现金，如现金差

额为负数，则投资人应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

6、申购赎回清单的格式

基本信息

基金名称	证券公司
基金管理公司名称	国联安基金管理有限公司
基金代码	159848
目标指数代码	399975
基金类型	跨市场 ETF

T-1 日信息内容

现金差额 (单位：元)	-7486.11
最小申购、赎回单位资产净值 (单位：元)	445108.89
基金份额净值 (单位：元)	0.8902

T 日信息内容

预估现金差额 (单位：元)	-7501.11
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 (单位：份)	500000
红利金额 (单位：元)	0.00
全部申购赎回组合证券只数	50
是否允许申购	是
是否允许赎回	是
当日累计申购份额上限	无

当日累计赎回份额上限	无
单个账户当日累计申购份额上限	无
单个账户当日累计赎回份额上限	无
当日累计净申购份额上限	无
当日累计净赎回份额上限	无
单个账户当日累计净申购份额上限	无
单个账户当日累计净赎回份额上限	无

成份股信息内容

证券代码	证券简称	股票数量	现金替代 标志	现金替代 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
000166	申万宏源	2400	允许	10%				深圳市场
000686	东北证券	400	允许	10%				深圳市场

说明：此表为示例，仅列示部分成份股

若深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对申购赎回清单的格式进行调整，基金管理人将视情况对相关格式进行相应的调整，并依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

（八）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常工作；
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 3、证券、期货交易所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；
- 4、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；
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可

能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形；

6、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，或者指数编制单位、证券交易所等因异常情况导致申购、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；

7、基金管理人开市前未能公布申购、赎回清单或者开市后发现IOPV计算错误、申购、赎回清单编制错误；

8、当日申购申请达到基金管理人设定的申购份额上限的情形；

9、申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单个投资者单日或单笔申购金额上限的；

10、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，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；

11、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第4、8、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购对价将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

（九）暂停赎回或延缓支付赎回对价的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回对价：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回对价；

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

3、证券、期货交易所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；

4、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形；

5、基金管理人开市前未能公布申购、赎回清单或者开市后发现IOPV计算错误、申购、赎回清单编制错误；

6、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

赎回，或者指数编制单位、证券交易所等因异常情况导致申购、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；

7、在发生标的指数成份股上市公司重大行为（如兼并重组）、成份股市场价格异常波动等异常情形时；

8、基金管理人可根据市场情况在申购、赎回清单中设置赎回份额上限，如果一笔新的份额赎回申请被确认成功，会使本基金当日赎回份额超过申购、赎回清单中规定的赎回份额上限时，该笔赎回申请将被拒绝；

9、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，基金管理人应当延缓支付赎回对价或暂停接受基金赎回申请；

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第8项以外情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回对价时，基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告，并在当日报中国证监会备案。已确认的赎回申请，基金管理人应足额兑付。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

二、基金销售机构

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基金的申购和赎回。

本基金通过登记机构进行的场外实物申购赎回的代理券商包括：中国银河证券股份有限公司。

本公司将适时增加或调整申购赎回代理券商，并在基金管理人网站公示。

三、重要提示

1、本公告仅对本基金开通场外实物申购赎回业务的有关事项进行说明，本基金的招募说明书中涉及的调整内容也将进行相应更新。

2、投资人在销售机构办理上述业务时，需同时遵循该销售机构的相关规定。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

投资人可访问本公司网站(www.cpicfunds.com)或打本公司的客户服务电话021-38784766或400-700-0365（免长途话费）咨询相关情况。

特此公告。

国联安基金管理有限公司

2021年9月3日