申万菱信上证50交易型开放式指数发起式证券投资基金招募说明书

（上接B7版）

本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投融资比例进行监督：

（1）按法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金的投资资产配置比例为：在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持市值不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（2）根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金投资组合遵循以下投资限制：

1）本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金资产的80%；

2）每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；

3）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

4）本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；

5）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

6）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

7）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

8）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

9）本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

10）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

11）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

12）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，在全国银行间同业市场中进行的债券回购期限不得超过1年，债券回购到期后不得展期；

13）基金总资产不得超过基金净资产的140%；

14）本基金参与股指期货、国债期货交易后，依据下列标准建构组合：

①在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

②在任何交易日日终，持有的买入股指期货、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

③在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

④本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

⑤在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

⑥在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；

⑦在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；

⑧本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

⑨在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；

15）若本基金参与融资的，在任何交易日日终，本基金融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产的95%；

16）本基金参与转融通证券出借交易，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的50%，证券出借的平均剩余期限不得超过30天，平均剩余期限按照市值加权平均计算；

17）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%，但符合中国证监会规定的标的指数成分股投资不计入受此限；

18）本基金管理人管理且由本基金托管人托管的的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%，但符合中国证监会规定的标的指数成分股投资不计入受此限。

19）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金不符合前述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

20）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行，且该等事项无需召开基金份额持有人大会。

（3）法规允许的基金投资比例调整期限除上述第（2）款中第10）、19）、20）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、标的指数成份股调整、标的指数成份股流动性限制等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前2个工作日正式向基金托管人发函说明基金可能变动规模和公司应对措施，便于托管人实施交易监督。

（4）本基金可以按照国家的有关规定进行融资和转融通证券出借业务。

除投资资产配置外，基金托管人对基金投资的监督和检查自《基金合同》生效之日起开始。

3、基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定对下述基金投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，本基金禁止从事下列行为：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

（5）向基金管理人、基金托管人出资。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制，且该等事项无需召开基金份额持有人大会。

4、基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

（1）基金管理人应按照基金托管人确定的文件格式向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人根据名单对基金管理人银行间市场交易进行监督。基金管理人拟增加或减少银行间市场交易对手的，应按照前述要求重新向基金托管人提交名单，并通过电话或邮件向基金托管人确认，拟调整名单经基金托管人确认后开始生效。因基金管理人未履行确认程序导致交易对手名单未变更的，基金托管人不承担责任。基金管理人知晓并同意新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，基金托管人有权报告中国证监会。

（2）基金管理人未提供交易对于名单或交易对于名单文件格式不符合托管人要求的，均视为未提供名单。基金管理人同意，基金托管人无需履行前款项下监督职责。因此给基金造成的损失由基金管理人承担。

基金管理人未提供交易对于名单，但基金托管人发现基金管理人与银行间市场的丙类会员进行债券交易的，可以通过邮件、电话等双方认可的方式提醒基金管理人，基金管理人应及时向基金托管人提供可行性说明。基金管理人应确保说明内容真实、准确、完整。基金托管人不对基金管理人提供的可行性说明进行实质审查。基金管理人同意，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，基金托管人不承担责任。

（3）基金管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，以DVP(券款兑付)的交易结算方式进行交易。

5、关于银行存款投资

本基金投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。基金管理人应基于审慎原则评估存款银行信用风险并拟此自行选择存款银行。因基金管理人违反上述原则给基金造成的损失，基金托管人不承担任何责任，相关损失由基金管理人先行承担。基金管理人履行先行赔付责任后，有权要求相关责任人进行赔偿。基金托管人的职责仅限于督促基金管理人履行先行赔付责任。

6、基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

（1）此处所述的流通受限证券与上文提及的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。基金投资流通受限证券，还应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

（2）基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

（3）基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期、基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

（4）基金托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定，对基金管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核基金管理人提供的有关书面信息。基金托管人认为上述资料可能导致基金出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人经事先书面告知基金管理人后，基金托管人有权拒绝执行有关指令，但应及时通知基金管理人。因拒绝执行该指令造成基金资产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果基金托管人没有切实履行监督职责，导致基金出现风险，基金托管人应承担连带责任。

（二）基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、《基金合同》、基金托管协议有关规定时，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向基金托管人发出回函，进行解释或举证。

在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因未进行监督而致使投资者遭受的损失。

对于依据交易程序尚未成交的且基托管人在交易前能够监控的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反关法律法规规定或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并报告中国证监会。

基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，必须在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权，或采取掩延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

第三节 基金管理人对基金托管人的业务核查

基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户和期货结算账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

（七）基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

基金财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。

（八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别应由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人在合同签署后5个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达基金托管人处。合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门15年以上。

第五节 基金资产净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以该计算日基金份额总份额后的数值。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，但如遇特殊情况，为保护基金持有人利益，基金管理人与基金托管人协商一致，可阶段性调整基金份额净值计算精度并进行相应公告，无需召开基金份额持有人大会审议。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应每工作日对基金资产估值，但基金管理人根据法律或《基金合同》的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金份额资产净值并以双方认可的方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，本基金的会计责任方是基金管理人，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

第六节 基金份额持有人名册的登记与保管

基金管理人和基金托管人须分别妥善保管的基金份额持有人名册，包括《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年6月30日、12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册由基金的登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应按照目前相关规则分别保管基金份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。

基金管理人应当及时向基金托管人提交下列日期的基金份额持有人名册：《基金合同》生效日、《基金合同》终止日、基金份额持有人大会权益登记日、每年6月30日、每年12月31日的基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容必须包括基金份额持有人的名称和持有的基金份额。其中每年12月31日的基金份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《基金合同》生效日、《基金合同》终止日等涉及到基金重要事项日期的基金份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

第七节 争议解决方式

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照该机构届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁的地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律（不含港澳台立法）管辖并从其解释。

第八节 托管协议的修改与终止

（一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会备案。

（二）基金托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

1、《基金合同》终止；

2、基金托管人解散、依法被撤销、破产或者其他基金托管人接管基金资产；

3、基金管理人解散、依法被撤销、破产或者其他基金管理人接管基金管理权；

4、发生法律法规或《基金合同》规定的终止事项。

第二十二部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为本基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人根据本基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加、修改这些服务项目。

一、为基金份额持有人提供的服务

1、基金份额持有人投资记录对账服务

基金份额持有人可直接登录公司网站下载或打印对账单，也可选择E-MAIL、短信、微信等方式得到投资记录对账服务。如基金份额持有人因特殊原因需获取指定期间的纸质对账单，可拨打本公司客服电话400-880-8588（免长途话费）或021-962299，公司将按流程为基金份额持有人免费邮寄。

2、互联网服务

基金管理人可利用公司官方网站(www.swsmu.com)、官方微信（SW_SMU）、申万菱信申级宝（SW_SMUZX）为基金份额持有人提供基金查询/交易服务及各类在线咨询服务。

二、服务渠道

1、咨询电话：+86-21-962299或400-880-8588（免长途话费）

2、网站：www.swsmu.com

3、微信：申万菱信基金（SW_SMU）或申万菱信申级宝（SW_SMUZX）

4、其他：如微博等

三、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系本公司。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，供公众查阅、复制。投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

第二十四部分 备查文件

（一）中国证监会准予申万菱信上证50交易型开放式指数发起式证券投资基金注册的文件

（二）《申万菱信上证50交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》

（三）《申万菱信上证50交易型开放式指数发起式证券投资基金托管协议》

（四）《法律意见书》

（五）基金管理人业务资格批件和营业执照

（六）基金托管人业务资格批件和营业执照

（七）注册登记协议

（八）中国证监会要求的其他文件

存放地点：上述备查文件存放在基金管理人、基金托管人的办公场所。

查阅方式：投资者可以在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金备查文件复制件或复印件，但应以基金备查文件正本为准。

申万菱信上证50交易型开放式指数发起式证券投资基金基金份额发售公告

（上接B5版）

2018年7 月23日至2018年7 月25日的上午9:30-11:30 和下午1:00-3:00（周六、周日及法定节假日不受理）。

（二）认购手续：

（1）开立上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户。

（2）在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

（3）投资者可通过填写认购委托单、电话委托、磁卡委托、网上委托等方式申报认购委托，可多次申报，申报一经确认，认购资金即被冻结。

具体时间和认购手续以上海证券交易所和发售机构的相关规定为准。

二、网下现金认购的程序

（一）直销机构

1、业务办理时间

2018年6月25日至2018年7 月25日9:00-17:00（周六、周日及法定节假日不受理）。

2、个人投资者的认购手续

个人投资者到本公司直销中心办理本基金认购手续，须提交下列资料：

（1）本人现时有效的法定身份证件（身份证、护照等）原件及复印件 ；

（2）上海证券交易所A 股账户或上海证券交易所证券投资基金账户原件及复印件；

（3）填妥的《ETF基金网下认购业务申请表》；

（4）指定银行账户的证明文件原件及复印件，如银行借记卡、储蓄卡等；

（5）加盖预留印鉴（私章）的《印鉴卡》一式2份；

（6）办理认购时还需提供加盖银行受理章的付款凭证回单联原件及复印件；

（7）填妥并签署《基金投资者风险测评问卷》（个人版，普通投资者适用）、《风险提示函》、《投资者分类认定结果及告知书》、《风险匹配告知书及投资者确认函》、《风险不匹配警示函及投资者确认书》（风险不匹配时适用）；

（8）填妥并签署《个人客户税收居民身份声明文件》；

（9）专业投资者资格证明材料（如需）。

3、机构投资者的认购手续

机构投资者到本公司直销中心办理本基金认购手续，须提交下列资料：

（1） 加盖单位公章的企业法人营业执照复印件及有效的副本原件，事业法人、社会团体或其它组织则须提供民政部门或主管部门颁发的注册登记书原件及加盖单位公章的复印件（若非三证合一，则需额外提供加盖单位公章的组织机构代码证及税务登记证复印件）；

（2） 上海证券交易所A 股账户或上海证券交易所证券投资基金账户原件及复印件 （加盖公章）；

（3）已填写好的《ETF基金网下认购业务申请表》，并加盖预留印鉴；

（4）指定银行账户的证明文件原件及复印件，如银行《开户许可证》或《开立银行账户申报表》等；

（5）加盖预留印鉴（公章、私章各一枚）的《印鉴卡》一式2份；

（6）加盖银行受理章的银行付款凭证回单联原件及复印件；

（7） 前来办理认购申请的机构经办人的现时有效的身份证件原件及复印件（二代身份证须提供正反两面，加盖公章）；

（8） 加盖机构公章和法定代表人的法人授权委托书；

（9） 法定代表人身份证复印件（二代身份证须提供正反两面，加盖公章）；

（10） 银保监会/证监会理财产品成立报批文件复印件、信托合同（首/末页）复印件等（针对产品开户）；

（11）填妥并签署《基金投资者风险测评问卷》（机构版，普通投资者适用）、《风险提示函》、《投资者分类认定结果及告知书》、《风险匹配告知书及投资者确认函》（普通投资者风险匹配时适用）、《风险不匹配警示函及投资者确认书》（普通投资者风险不匹配时适用）。

（12）填妥并签署《机构客户税收居民身份声明文件》（如需）、《控制人客户税收居民身份声明文件》（如需）；

（13）专业投资者资格证明材料（如需）。

4、合格境外机构投资者（QFII）的认购手续

合格境外机构投资者（QFII）在直销中心办理本基金认购手续，须提供下列材料：

（1）如果通过合格境外投资者的托管银行办理有关业务，该托管银行须提供在中国境内的营业执照或者营业许可证，以及托管协议复印件，须加盖托管银行公章，进行公证或者律师见证；

（2）合格境外机构投资者证券投资业务许可证的复印件以及相关投资额度的审批证明，须加盖托管银行公章，并进行公证或者律师见证；

（3） 上海证券交易所A 股账户或上海证券交易所证券投资基金账户原件及复印件 （加盖公章）；

（4）已填写好的《ETF基金网下认购业务申请表》，并加盖预留印鉴；

（5）经合格境外机构投资者签字并加盖公章的授权委托书；

（6）前来办理认购申请的经办人现时有效的身份证件原件及复印件（二代身份证须提供正反两面，加盖公章）；

（7）预留印鉴卡一式2份；

（8）加盖银行受理章的银行付款凭证回单联原件及复印件；

（9）指定银行账户的证明文件及复印件；

（10）签署《风险提示函》、《投资者分类认定结果及告知书》；

（11）填妥并签署《机构客户税收居民身份声明文件》（如需）、《控制人客户税收居民身份声明文件》（如需）。

5、投资者办理认购前应将足额资金通过指定银行账户汇入下列任一本公司直销中心账户：

（1）户名：申万菱信基金管理有限公司直销中心专户

账号：1001202929025736553

开户行：中国工商银行上海市分行营业部

大额支付号：102290020294

交换号：022029

（2）户名：申万菱信基金管理有限公司

账号：212289058810001

开户行：招商银行上海淮中支行

大额支付号：308290003378

交换号：096657

投资者若因未向上述指定账户足额划付认购资金，造成其认购不成功的，本公司及“申万菱信基金管理有限公司”和“申万菱信基金管理有限公司直销中心专户”的开户银行不承担任何责任。

6、汇款时，投资者须注意以下事项：

（1）投资者在认购时不能使用申万菱信基金管理有限公司开放式基金账户，而需使用上海证券交易所A 股账户或上海证券交易所证券投资基金账户。

（2）投资者应在“汇款人”栏中填写其上海证券交易所A 股账户或上海证券交易所证券投资基金账户登记的名称。

（3）投资者应在汇款附言/用途/摘要/备注栏正确填写上海证券账户信息，并预留有效的联系方式，便于发生资金异常时及时通知；汇款时应提示银行柜台人员准确完整地传递上述汇款信息。

（4）为确保投资者资金及时准确入账，建议投资者将加盖银行业务受理章的汇款单据传真至本公司直销柜台。

（5）认购申请当日17:00之前，若投资者的认购资金未到达本公司的指定账户，当日提交的认购申请无效。申请受理日期（即有效申请日）以资金到账日为准。

（二）发售机构

1、业务办理时间：

2018年6月25日至2018年7 月25日的具体业务办理时间以各发售机构的规定为准。

2、认购手续：

1）开立上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户。

2）在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

3）投资者可通过填写认购委托单，同时填写委托该发售机构代为办理网上现金认购的委托申请书。申报一经确认，认购资金即被冻结。

具体认购手续以各发售机构的规定为准。

三、网下股票认购的程序

（一）业务办理时间：

2018 年6月25日至2018年7月25上午9:30-11:30 和下午13:00-15:00（周六、周日及法定节假日不受理）。具体时间以基金管理人及发售机构的规定为准。

（二）认购手续：

（1）开立上海证券交易所A股账户，办理指定交易或转指定交易。

（2） 在上海证券交易所A股账户中具备足够的符合要求的标的指数成份股和已公告的备选成份股。

（3）投资人填写《ETF基金网下认购业务申请表》。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网下股票认购，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。

第五部分 清算与交割

一、通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在基金募集期间产生的利息，在基金合同生效后将折算为基金份额，归基金份额持有人所有，利息转份额以登记机构的记录为准；网上现金认购和通过发售机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后产生的利息，计入基金财产，不折算为投资者基金份额；网下股票认购所募集的股票在网下股票认购日至登记机构进行股票过户日的冻结期间所产生的权益归投资者所有。

二、基金管理人应将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。基金募集期间的股票由发售机构予以冻结。

三、本基金权益登记由登记机构在发售结束后完成过户登记。

第六部分 基金的验资与基金合同生效

一、基金备案的条件

本基金为发起式基金，发起资金提供方认购本基金的总金额不少于1000万元，发起资金提供方承诺持有期限不少于3年的条件下，基金募集期届满或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，验资报告需对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明。自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会提交验资报告，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

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，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款项，并加计银行同期活期存款利息，同时将已冻结的股票解冻；

3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

第七部分 本基金募集当事人或中介机构

一、基金管理人

申万菱信基金管理有限公司

注册地址：上海市中山南路100号11层

法定代表人：刘郎

电话：86-21-23261188

传真：86-21-23261199

联系人：赵鹏

客户服务电话：400-880-8588（免长途话费）或86-21-962299

网址：www.swsmu.com

电子邮件：service@swsmu.com

二、基金托管人

中国工商银行股份有限公司

注册地址：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：易会满

注册资本：人民币35,640,625.71万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

三、基金份额销售机构

1、发售协调人

名称：申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

客户服务电话：95523或4008895523

网址：www.swhysc.com

2、网下现金和网下股票发售直销机构

名称：申万菱信基金管理有限公司直销中心

注册地址：上海市中山南路100号11层

办公地址：上海市中山南路100号11层

法定代表人：刘郎

电话：86-21-23261188

传真：86-21-23261199

联系人：陈继红

客户服务电话：400 880 8588（免长途话费）或86-21-962299

网址：www.swsmu.com

电子邮件：service@swsmu.com

3、网下现金发售机构

(1)名称：东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层

法定代表人：潘鑫军

联系人：胡月茹

传真：021-63326729

客户服务电话：021-95503

东方证券网站：www.dfzq.com.cn

(2)名称：光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号

办公地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

(3)名称：国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：杨德红

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客户服务热线：95521

公司网站：www.gtja.com

(4)名称：海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

办公地址：上海市广东路689号

法定代表人：王开国

联系人：金芸、李笑鸣

客户服务电话：400-8888-001(全国)，021-95553，或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网站：www.htsec.com

(5)名称：平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

办公地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法定代表人：詹露阳

客户服务电话：95511-8

传真：0755-82435367

网址：http://stock.pingan.com

(6)名称：中万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

电话：021-33389888

传真：021-33388224

(11)名称：招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人：宫少林

传真：0755-82943636

联系人：林生迎

客户服务热线：4008888111，95565

公司网站：www.newone.com.cn

(12)名称：中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路86号

办公地址：山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889185

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

(13)名称：中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳门内大街188号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：010-65182261

公司网站：www.csc108.com

(14)名称：中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：顾凌

网址：www.cs.ecitic.com

(15)名称：中信证券(山东)有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

办公地址：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层

法定代表人：杨宝林

客户服务电话：95548

网址：www.zxwt.com.cn

4、网下股票发售机构

(1)名称：东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层

法定代表人：潘鑫军

联系人：胡月茹

传真：021-63326729

客户服务电话：021-95503

东方证券网站：www.dfzq.com.cn

(2)名称：光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号

办公地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客户服务电话：95525

公司网址：www.ebscn.com

(3)名称：国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区商城路618号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼

法定代表人：杨德红

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客户服务热线：95521

公司网站：www.gtja.com

(4)名称：海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

办公地址：上海市广东路689号

法定代表人：王开国

联系人：金芸、李笑鸣

客户服务电话：400-8888-001(全国)，021-95553，或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网站：www.htsec.com

(5)名称：平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

办公地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层

法定代表人：詹露阳

客户服务电话：95511-8

传真：0755-82435367

网址：http://stock.pingan.com

(6)名称：中万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523或4008895523

电话委托：021-962505

公司网址：www.swhysc.com

(7)名称：申万宏源西部证券有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

法定代表人：韩志谦

联系人：王怀春

客户服务电话：4008-000-562

传真：010-88085195

网址：www.hysec.com

(8)名称：中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈有安

客户服务热线：4008888888

传