

申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资 基金基金份额发售公告

2024-12-31 来源：上海证券报

重要提示

- 1、申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已于 2024 年 12 月 4 日获中国证监会证监许可【2024】1758 号文注册。中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。
- 2、本基金为交易型开放式、股票型、被动指类型证券投资基金。
- 3、本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司（以下简称“本公司”），基金托管人为中国农业银行股份有限公司，登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。
- 4、本基金的发售对象为符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

5、投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式认购本基金。

6、本基金的发售期为 2025 年 1 月 6 日至 2025 年 1 月 17 日。其中，网上现金发售的日期为 2025 年 1 月 6 日至 2025 年 1 月 17 日，网下现金发售的日期为 2025 年 1 月 6 日至 2025 年 1 月 17 日，网下股票发售的日期为 2025 年 1 月 6 日至 2025 年 1 月 17 日。如证券交易所对网上现金认购时间作出调整，本公司将作出相应调整并及时公告。本基金管理人可以根据认购的情况提前终止或延迟募集期并及时公告，但募集期最多不超过 3 个月。

7、本基金首次募集规模上限为 20 亿元(不包括募集期利息)，基金首次募集规模不得超过募集目标上限，若募集期投资者的认购规模超过募集规模上限，基金管理人将采取全程比例确认的方式实现规模的有效控制。当发生比例确认时，基金管理人将及时公告比例确认情况与结果。

8、投资人认购本基金时需具有上海证券交易所 A 股账户或上海证券交易所证券投资基金账户（以下统称证券账户）。已有证券账户的投资者不必再办理开户手续。尚无证券账户的投资者，需在认购前持本人身份证件到中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的开户代理机构办理证券账户的开户手续。有关开设证券账户的具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询有关规定。

9、本基金认购费用或认购佣金由认购基金份额的投资人承担，认购费率不超过认购份额的 0.8%。基金管理人办理网下现金认购时按照本公告列示认购费

率收取认购费用，基金管理人办理网下股票认购时不收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购及网下股票认购时可参照本公告列示认购费率结构，按照不超过认购份额 0.8%的标准收取一定的佣金。投资者多次申请现金认购的，须按每笔认购申请所对应的费率档次分别计费。

基金管理人可以针对特定投资人（如养老金客户等）开展网下现金认购的费率优惠活动，详见基金管理人发布的相关公告。

10、网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为 1,000 份或其整数倍，最高不得超过 99,999,000 份。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

网下现金认购以基金份额申请。投资者通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为 1,000 份或其整数倍；投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在 10 万份以上（含 10 万份）。投资人可以多次认购，累计认购份额不设上限，法律法规、中国证监会或基金合同另有规定的除外。

网下股票认购以单只股票股数申报。投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构进行网下股票认购，单只股票最低认购申报股数为 1,000 股，超过 1,000 股的部分须为 100 股的整数倍。投资人应以 A 股账户认购。用于认购的股票必须是符合要求的标的指数成份股和已公告的备选成份股（详见本公告第八部分）。投资人可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

11、在基金合同生效后，投资者可通过其办理认购的销售机构查询认购确认情况。销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利，否则，由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

12、各发售机构办理发售业务的办理网点、办理日期和时间等事项参考各发售代理机构的具体规定。

13、发售期内，本基金有可能新增或者变更发售代理机构，敬请留意本公司及各发售代理机构的公告，或拨打本公司及各发售代理机构客户服务电话咨询。

14、本基金《基金合同》生效后，符合基金上市交易条件的，本基金基金份额可申请在上海证券交易所上市交易。上市交易的有关事项将另行公告。

15、投资者可拨打本公司的客户服务电话 400-880-8588（免长途话费）或 86-21-962299 及直销专线电话 86-21-23261088 或发售机构客户服务电话垂询认购事宜。

16、本公告仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请详细阅读刊登在本公司网站（www.swsmu.com）和中国

证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csdc.gov.cn/fund>) 上的《申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金管理说明书》。

17、基金募集期结束后，基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商，经上海证券交易所等有关机构认可后，予以公告。本基金上市后，未登记在申购赎回代理券商的基金份额只能进行本基金的二级市场买卖，如投资者需进行本基金的申购赎回交易，须转托管到本基金的申购赎回代理券商。

18、风险提示

本基金投资于证券、期货市场，基金净值会因为证券、期货市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、信用风险、管理风险、本基金特有的风险、金融期货投资风险、股票期权投资风险、资产支持证券投资风险、存托凭证投资风险、参与融资和转融通证券出借业务的风险、北京证券交易所股票和科创板上市股票的投资风险、税负增加风险、基金进入清算期的相关风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险、流动性风险和其他风险等。

本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险，详见本基金招募说明书“风险揭示”章节。基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同及基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证 A500 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

本基金投资范围包括股指期货、国债期货，若投资可能面临市场风险、流动性风险、交易对手风险和国债期货交割风险等特有风险。

本基金可投资股票期权，在投资过程中可能存在市场风险、行权风险、流动性风险和时间价值风险等特有风险。

本基金的投资范围包括存托凭证，若投资可能面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等相关的风险。

本基金可投资北京证券交易所上市股票，可能面临投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险、流动性风险、上市公司经营风险、上市公司退市风险等。

本基金可按照基金合同的约定投资科创板上市股票。上海证券交易所科创板股票相比 A 股其他板块股票，将承担因上市条件、交易规则、退市制度等差异带来的特有风险。

本基金可投资资产支持证券，在投资过程中可能存在因债务人的违约或交收违约、资产支持证券信用质量降低而产生的信用风险，因利率变化等原因债务人进行提前偿付而导致的提前偿付风险，因市场交易不活跃而导致的流动性风险等，由此可能造成基金财产损失。

本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资和转融通证券出借业务，参与融资和转融通证券出借业务可能存在市场风险、流动性风险和信用风险等。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

第一部分 本次募集的基本情况

一、基金名称

申万菱信中证 A500 交易型开放式指数证券投资

基金简称：申万菱信中证 A500ETF

场内简称：A500 申万

扩位简称：A500ETF 申万菱信

基金代码：560750

认购代码：560753

认购资金代码：560754

二、基金的类别

股票型、被动指数型证券投资基金

三、基金的运作方式

交易型开放式

四、基金存续期限

不定期

五、基金份额初始面值和认购费用

本基金基金份额初始发售面值为人民币 1.00 元，认购价格为 1.00 元/份。

六、募集对象

符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

七、基金的最低募集份额总额和最低募集金额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份，基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不少于 2 亿元人民币。

八、销售机构

具体名单详见本份额发售公告“第七部分 三、基金份额销售机构”。

九、发售时间安排

本基金的发售期为 2025 年 1 月 6 日至 2025 年 1 月 17 日。其中，网上现金发售的日期为 2025 年 1 月 6 日至 2025 年 1 月 17 日，网下现金发售的日期为 2025 年 1 月 6 日至 2025 年 1 月 17 日，网下股票发售的日期为 2025 年 1 月 6 日至 2025 年 1 月 17 日。如证券交易所对网上现金认购时间作出调

整，本公司将作出相应调整并及时公告。本基金管理人可以根据认购的情况提前终止或延迟募集期并及时公告，但募集期最多不超过3个月。

十、募集方式

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式认购本基金。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构在上海证券交易所网上系统以现金进行的认购。

网下现金认购是指投资者通过基金管理人或其指定的发售代理机构以现金进行的认购。

网下股票认购是指投资者通过基金管理人或其指定的发售代理机构以股票进行的认购。

十一、认购费用

认购费用或认购佣金由认购基金份额的投资人承担，不列入基金财产，认购费率不超过认购份额的0.8%，主要用于基金的市场推广、销售、登记结算等募集期间发生的各项费用。认购费率如下表所示：



基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用，基金管理人办理网下股票认购时不收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购及网下股票认购时可参照上述费率结构，按照不超过认购份额0.8%的标准收取一定的佣金。投资者多次申请现金认购的，须按每笔认购申请所对应的费率档次分别计费。本基金认购费用由认购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金募集期间发生的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

基金管理人可以针对特定投资人（如养老金客户等）开展网下现金认购的费率优惠活动，详见基金管理人发布的相关公告。

十二、网上现金认购

1、认购程序

投资者认购时间安排、认购时应提交的文件和办理的手续，详见基金份额发售公告。

2、网上现金认购金额的计算

通过发售代理机构进行网上现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购佣金、认购金额的计算方法如下：

当认购佣金适用比例费率时：

认购佣金=认购价格×认购份额×佣金比率

认购金额=认购价格×认购份额×(1+佣金比率)

当认购佣金为固定金额时：

认购佣金 = 固定金额

认购金额=认购价格×认购份额+固定金额

认购佣金由发售代理机构向投资者收取，投资者需以现金方式交纳认购佣金。

网上现金认购的有效认购款项在基金募集期间产生的利息计入基金财产，不折算为投资者基金份额。

举例说明：

假设某投资者通过某发售代理机构以网上现金认购方式认购 1,000 份本基金基金份额，该发售代理机构确认的佣金比例为 0.8%，则投资者需支付的认购佣金和需准备的认购金额计算如下：

认购佣金=1.00×1,000×0.8%=8.00 元

认购金额=1.00×1,000×(1+0.8%) =1,008.00 元

即：该投资者需准备 1,008.00 元资金，方可认购到 1,000 份本基金基金份额。

3、认购限额

网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为 1,000 份或其整数倍，最高不得超过 99,999,000 份。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

4、认购申请

投资者在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。投资人可多次提出认购申请，网上现金认购申请提交后，投资者可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。

5、清算交收

T 日通过发售代理机构提交的网上现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金，登记机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人于网上现金认购结束后的 4 个工作日内将实际到位的认购资金划往基金管理人预先开设的基金募集专户。

6、认购确认

在基金合同生效后，投资人应通过其办理认购的发售代理机构查询认购确认情况。

十三、网下现金认购

1、认购程序

投资者认购时间安排、认购时应提交的文件和办理的手续，详见基金份额发售公告。

2、网下现金认购金额和利息折算的份额的计算

(1) 通过基金管理人进行网下现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购费用和认购金额的计算公式为：

当认购费用适用比例费率时：

认购费用=认购价格×认购份额×认购费率

认购金额=认购价格×认购份额×(1+认购费率)

当认购费用为固定金额时：

认购费用=固定金额

认购金额=认购价格×认购份额+固定金额

认购总份额=认购份额+有效认购款项产生的利息/基金份额初始发售面值

有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，利息转份额以基金管理人的记录为准。利息折算的基金份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

举例说明：

假设某投资者通过基金管理人以网下现金认购方式认购 800,000 份本基金基金份额，认购费率为 0.5%，假定募集期间认购资金所得利息为 10 元且该笔认购全部予以确认，则其可得到的基金份额计算如下：

认购费用=1.00×800,000×0.5%=4000 元

认购金额=1.00×800,000× (1+0.5%) =804,000 元

认购总份额=800,000+10/1.00=800,010 份

即：该投资者通过基金管理人网下现金认购 800,000 份本基金基金份额，则该投资者的认购金额为 804,000 元，假定该笔认购金额产生利息 10 元，则该投资者共可获得 800,010 份基金份额。

(2) 通过发售代理机构进行网下现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购佣金和认购金额的计算同通过发售代理机构进行网上现金认购的计算。

3、认购限额

网下现金认购以基金份额申请。投资者通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为 1,000 份或其整数倍；投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在 10 万份以上（含 10 万份）。投资人可以多次认购，累计认购份额不设上限，法律法规、中国证监会或基金合同另有规定的除外。

4、认购手续

投资者在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，到发售代理机构的销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后如需撤销以发售代理机构的规定为准。

5、清算交收

通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人进行有效认购款项的清算交收，将认购资金划入基金管理人预先开设的基金募集专户。

通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金。在网下现金认购的最后一个工作日，各发售代理机构将每一个投资人账户提交的网下现金认购申请汇总后，通过上海证券交易所上网定价发行系统代该投资人提交网上现金认购申请。之后，登记机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人将实际到位的认购资金划往基金管理人预先开设的基金募集专户。

6、认购确认

在基金合同生效后，投资人应通过其办理认购的发售代理机构查询认购确认情况。

十四、网下股票认购

1、认购程序

投资者认购时间安排、认购时应提交的文件和办理的手续，详见基金份额发售公告。

2、认购限额

网下股票认购以单只股票股数申报。投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构进行网下股票认购，单只股票最低认购申报股数为 1,000 股，超过 1,000 股的部分须为 100 股的整数倍。投资人应以 A 股账户认购。用于认购的

股票必须是符合要求的标的指数成份股和已公告的备选成份股（详见基金份额发售公告）。投资人可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

3、认购手续

投资者在认购本基金时，需按基金管理人或发售代理机构的规定，到发售网点办理认购手续，并备足认购股票。网下股票认购申请提交后如需撤销以基金管理人或发售代理机构的规定为准。

4、特殊情形

- (1) 已公告的将被调出标的指数的成份股不得用于认购本基金。
- (2) 限制个股认购规模：基金管理人可根据网下股票认购开始日前 3 个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购开始日前至少 3 个工作日公告限制认购规模的个股名单。
- (3) 临时拒绝个股认购：对于在网下股票认购期间价格波动异常，或长期停牌的个股，或认购申报数量异常的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。
- (4) 募集结束前，如标的指数成份股出现调整，则调入名单中的股票也将纳入认购清单。

(5) 根据法律法规本基金不得持有的标的指数成份股，将不能用于认购本基金。

5、清算交收

网下股票认购最后一日日终，发售代理机构将当日的股票认购数据按投资人证券账户汇总发给基金管理人，基金管理人收到股票认购数据后初步确认各成份股的有效认购数量。认购截止日次一工作日起，登记机构根据基金管理人提供的确认数据将投资者上海市场网下认购股票进行冻结，并将投资者深圳市场网下认购股票过户至中国证券登记结算有限公司深圳分公司的证券认购专户。基金募集期结束后，基金管理人为投资人计算认购份额，并根据发售代理机构提供的数据计算投资人应以基金份额方式支付的佣金（如适用以基金份额的方式支付认购费用的），从投资人的认购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额。登记机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记，并根据基金管理人提供的有效认购申请股票数据，将上海和深圳的股票过户至本基金在上海、深圳开立的证券账户。

6、网下股票认购份额的计算

认购份额 =

?? = 1

??

第 i 只股票在网下股票认购期最后一日的均价 \times 有效认购数量

1.00

其中：

1) i 代表投资者提交认购申请的第 i 只股票， n 代表投资者提交的股票总只数。如投资者仅提交了 1 只股票的申请，则 $n = 1$ 。

2) “第 i 只股票在网下股票认购期最后一日的均价”由基金管理人根据证券交易所的当日行情数据，以该股票的总成交金额除以总成交股数计算，以四舍五入的方法保留小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交，则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，由于投资人获得了相应的权益，基金管理人将按如下方式对该股票在网下股票认购期最后一日的均价进行调整：

①除息：调整后价格 = 网下股票认购期最后一日均价 - 每股现金股利或股息

②送股：调整后价格 = 网下股票认购期最后一日均价 / (1 + 每股送股比例)

③配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例）/（1+每股配股比例）

④送股且配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例）/（1+每股送股比例+每股配股比例）

⑤除息且送股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价 - 每股现金股利或股息）/（1+每股送股比例）

⑥除息且配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价 + 配股价×配股比例 - 每股现金股利或股息）/（1+每股配股比例）

⑦除息、送股且配股：调整后价格=（网下股票认购期最后一日均价+配股价×配股比例-每股现金股利或股息）/（1+每股送股比例+每股配股比例）

以上调整后价格采用四舍五入方法，保留到小数点后2位。

3) “有效认购数量”是指由基金管理人确认的并据以进行清算交收的股票股数。其中：

①对于经公告限制认购规模的个股，基金管理人可确认的认购数量上限的计算方式详见届时相关公告。如果投资人申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限，则按照各投资人的认购申报数量同比例收取。对

于基金管理人未确认的认购股票，登记机构将不办理股票的过户业务，正常情况下，投资人未确认的认购股票将在认购截止日后的 4 个工作日起可用。

②若某一股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生司法执行，基金管理人将根据登记机构确认的实际过户数据对投资人的有效认购数量进行相应调整。

7、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。

第二部分 发售方式及相关规定

一、本基金面向个人投资者和机构投资者发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式认购本基金。

二、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将折算为基金份额，归基金份额持有人所有，利息转份额以基金管理人的记录为准；网上现金认购和通过发售代理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至划入基金托管账户前产生的利息，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（不含）的冻结期间所产生的权益归投资者所有。

三、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。网下股票认购所募集的股票由发售代理机构予以冻结。

四、在不违反法律法规及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可根据基金发展需要，在履行适当程序后，募集并管理以本基金为目标 ETF 的一只或多只联接基金，或为本基金增设新的基金份额类别，并需在调整实施之日前依照《公开募集证券投资基金管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。

第三部分 投资者开户

投资人认购本基金时需具有上海证券交易所 A 股账户或上海证券交易所证券投资基金账户（以下统称证券账户）。

已有证券账户的投资者不必再办理开户手续。

尚无证券账户的投资者，需在认购前持本人身份证件到中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的开户代理机构办理证券账户的开户手续。有关开设证券账户的具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询有关规定。

1、如投资人需新开立证券账户，则应注意：

(1) 上海证券交易所证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易，如投资人需要使用标的指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金份额的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户；如投资人需要使用标的指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所 A 股账户，且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资者所有，用以认购基金份额的发售代理机构和上海 A 股账户指定交易证券公司应为同一发售代理机构。

(2) 上海证券交易所 A 股账户开户当日无法办理指定交易，建议投资人正在进行认购前至少 2 个工作日办理开户手续。

2、如投资人已开立证券账户，则应注意：

(1) 如投资人未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司，需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

(2) 当日办理指定交易或转指定交易的投资人当日无法进行认购，建议投资人在正在进行认购前至少 1 个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

(3) 使用专用交易单元的机构投资者无需办理指定交易。

第四部分 本基金的认购程序

一、网上现金认购的程序

(一) 业务办理时间：

2025年1月6日至2025年1月17日上午9:30—11:30 和下午1:00—3:00（周六、周日及节假日不受理）。如上海证券交易所对网上现金认购时间作出调整，以上海证券交易所最新规定为准。

(二) 认购手续：

- (1) 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) 网上现金认购申请提交后，投资人可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。

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

2025年1月6日至2025年1月17日，具体业务办理时间由基金管理人确定。

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（身份证件、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) 签署《基金投资人风险承受能力调查问卷》；

(5) 公司要求提供的其他有关材料。

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；
- (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) 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）；
- (5) 加盖机构公章和法定代表人章的法人授权委托书；
- (6) 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）；
- (7) 签署《基金投资人风险承受能力调查问卷》；
- (8) 公司要求提供的其他有关材料。

4、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

(3)户名：申万菱信基金管理有限公司直销中心专户

账号：310066771018800056838

开户行：交通银行上海陆家嘴支行

支付系统行号：301290050828

(4)户名：申万菱信基金管理有限公司直销中心专户

账号：216200100102084040

开户行：兴业银行股份有限公司上海分行

支付系统行号：309290000107

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。

5、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交易所 A 股账户或上海证券交易所证券投资基金账户信息，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。

(6) 投资者若未按上述规定划付款项，造成认购无效的，本公司及直销网点清算账户的开户银行不承担任何责任。

（二）发售代理机构

1、业务办理时间：

2025 年 1 月 6 日至 2025 年 1 月 17 日，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下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代理机构的规定为准。

三、网下股票认购的程序

1、直销机构

(一) 业务办理时间：

2025年1月6日至2025年1月17日，具体业务办理时间由基金管理人确定。

(二) 认购手续：

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股账户原件及复印件；
- (3) 填妥的《ETF基金网下认购业务申请表》；
- (4) 签署《基金投资人风险承受能力调查问卷》；
- (5) 公司要求提供的其他有关材料。

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 股账户原件及复印件；
- (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) 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）；
- (5) 加盖机构公章和法定代表人章的法人授权委托书；
- (6) 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）；
- (7) 签署《基金投资人风险承受能力调查问卷》；
- (8) 公司要求提供的其他有关材料。

2、发售代理机构

(一) 业务办理时间:

2025年1月6日至2025年1月17日，具体业务办理时间以各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。
- 2) 在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) 投资人填写认购委托单。申报一经确认，认购股票即被冻结。

3、特别提示:

- (1) 已公告的将被调出标的指数的成份股不得用于认购本基金。
- (2) 限制个股认购规模：基金管理人可根据网下股票认购开始日前3个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购开始日前至少3个工作日公告限制认购规模的个股名单。

(3) 临时拒绝个股认购：对于在网下股票认购期间价格波动异常，或长期停牌的个股，或认购申报数量异常的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。

(4) 募集结束前，如标的指数成份股出现调整，则调入名单中的股票也将纳入认购清单。

(5) 根据法律法规本基金不得持有的标的指数成份股，将不能用于认购本基金。

第五部分 清算与交割

一、基金募集期间募集的现金认购资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

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将折算为基金份额，归基金份额持有人所有，利息转份额以基金管理人的记录为准；网上现金认购和通过发售代理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至划入基金托管账户前产生的利息，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（不含）的冻结期间所产生的权益归投资者所有。

二、本基金权益登记由登记机构在基金募集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

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，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。基金管理人应当自基金募集期结束之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，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。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，任何人均不得动用。网下股票认购所募集的股票由发售代理机构予以冻结。

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 日内返还投资者已交纳的款项，并加计银行同期活期存款利息，对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票，登记机构应予以解冻，基金管理人不承担相关股票冻结期间交易价格波动的责任。登记机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作；

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：陈晓升

电话：86-21-23261188

传真：86-21-23261199

联系人：蔡琳娜

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

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：谷澍

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：任航

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： 张剑

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：陈晓升

电话：86-21-23261188

传真：86-21-23261199

联系人：张芸茜

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、网下现金发售代理机构

■

本公司可以根据情况变化调整网下现金发售机构，具体名单详见基金管理人网站的公告或公示。各销售机构具体业务办理情况以其各自规定为准。

4、网下股票发售代理机构

■

本公司可以根据情况变化调整网下股票发售机构，具体名单详见基金管理人网站的公告或公示。各销售机构具体业务办理情况以其各自规定为准。

5、网上现金发售机构

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理，具体名单可在上海证券交易所网站查询。

6、基金管理人可根据有关法律法规要求，根据实情，选择其他符合要求的机构销售本基金或变更上述发售机构，并在基金管理人网站公告或公示。具体请以各发售机构具体业务办理情况以其各自规定为准。

四、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：于文强

联系人：赵亦清

电话: (010) 50938782

传真: (010) 50938991

五、出具法律意见书的律师事务所

名称: 上海市通力律师事务所

住所: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人: 韩炯

电话: (021) 31358666

传真: (021) 31358600

联系人: 陈颖华

经办律师: 黎明、陈颖华

六、审计基金财产的会计师事务所

名称: 毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场 2 座办公楼 8 层

办公地址：上海静安区南京西路 1266 号恒隆广场二期 16 楼

法定代表人：邹俊

电话：(010) 8508 5000

传真：(010) 8508 5111

联系人：虞京京

经办注册会计师：王国蓓、虞京京

第八部分 本基金网下股票认购清单

本基金募集期间，网下股票认购名单如下表所示，但募集期结束前已公告的将被调出标的指数的成份股不得用于认购本基金。基金管理人可根据网下股票认购日前 3 个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购开始日前至少 3 个工作日公告限制认购规模的个股名单。对于在网下股票认购期间价格波动异常，或长期停牌的个股，或认购申报数量异常的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。如果投资者的个股认购规模超过该券在标的指数的构成比

例，基金管理人有权对超过构成比例的部分予以拒绝。募集结束前，如标的指数成份股出现调整，则调入名单中的股票也将纳入认购清单。

■

申万菱信基金管理有限公司

2024年12月31日

申万菱信基金管理有限公司

申万菱信中证A500交易型开放式指数证券投资基金

基金合同及招募说明书提示性公告

申万菱信中证A500交易型开放式指数证券投资基金基金合同和招募说明书于2024年12月31日在本公司官方网站（www.swsmu.com）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn>）披露，供投资者查阅。如有疑问可拨打本公司客服电话（400-880-8588）咨询。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。请充分了解本基金的风险收益特征，审慎做出投资决定。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司

2024年12月31日

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇二四年十二月