

中信建投中证北京 50 交易型开放式 指数证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人：中信建投基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

二零一八年六月

目录

重要提示	3
一、基金募集的基本情况.....	6
二、发售方式及相关规定.....	9
三、投资者开户	14
四、网上现金认购	15
五、网下现金认购	15
六、网下股票认购	20
七、清算与交割	21
八、基金的验资与基金合同的生效.....	22
九、本次募集有关当事人或中介机构.....	22
十、网下股票认购清单	24

重要提示

1. 中信建投中证北京 50 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已获中国证监会证监许可[2018]398 号文予以注册。中国证监会对本基金的注册并不代表中国证监会对本基金的风险和收益做出实质性判断或者保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

2. 本基金类别为股票型、指数型证券投资基金，运作方式为交易型开放式。

3. 本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司（以下简称“本公司”），基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”），登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4. 本基金募集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、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构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. 本基金自 2018 年 7 月 2 日至 2018 年 8 月 31 日进行发售。投资者可选择网下现金认购、网下股票认购和网上现金认购 3 种方式。其中，网下现金和网下股票认购的日期为 2018 年 7 月 2 日至 2018 年 8 月 31 日，网上现金认购的日期为 2018 年 8 月 29 日至 2018 年 8 月 31 日。

6. 本公司可办理网下现金发售和网下股票发售。

7. 本基金网上现金认购通过具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理。

8. 网下现金认购和网下股票认购的发售代理机构为中信建投证券股份有限公司等代销机构。

9. 投资者投资本基金时需具有上海证券交易所 A 股账户或基金账户。其中，上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易，如投资者需要使用中证北京 50 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的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户；如投资者需要使用中证北京 50 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。

10. 本基金认购费用或认购佣金不高于 0.80%。具体费用或佣金详见下文。

11. 本基金不设募集规模上限。

12. 网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额须为 1000 份或其整数倍，最高不得超过 99,999,000 份。投资者应以上海证券账户认购。投资者可多次认购，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，每笔认购份额须为 1000 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 5 万份以上（含 5 万份）。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

网下股票认购以单只股票股数申报，用以认购的股票必须是中证北京 50 指数成份股和已公告的备选成份股。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。投资者应以 A 股账户认购，可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

13. 网上现金认购本基金时，投资者需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。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；网下现金认购本基金时，投资者需按销售机构的规定，到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回以销售机构的规定为准；网下股票认购本基金时，投资者需按销售机构的规定，到销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回以销售机构的规定为准。

14. 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。

15. 基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，网下股票认购募集的股票予以冻结，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

16. 本公告仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明。投资人欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读 2018 年 6 月 28 日刊登在《中国证券报》上的《中信建投中证北京 50 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。本基金的基金合同、托管协议、招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站及上海证券交易所

网站。

17. 募集期内，本基金还有可能新增或者变更发售代理机构，敬请留意近期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。

18. 投资者可拨打本公司全国统一服务热线 4009-108-108（免长途话费）或各销售机构咨询电话了解认购事宜。

19. 基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整，并可根据基金销售情况适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

20. 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名单，经上海证券交易所等有关部门认可后，予以公告。本基金上市后，指定交易未在申购赎回代理券商的投资人只能进行本基金的二级市场买卖，如投资人需进行本基金的申购赎回交易，须指定交易或转指定交易到申购赎回代理券商。

21. 风险提示：投资有风险，投资者认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书及基金合同等信息披露文件。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也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券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：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于投资者连续大量赎回基金份额产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险等等。同时由于本基金是跟踪中证北京 50 指数的交易型开放式指数基金，投资本基金可能遇到的风险还包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、申赎清单差错风险、二级市场流动性风险、第三方机构服务的风险、管理风险与操作风险、技术风险、不可抗力等等。本基金主要采用完

全复制法跟踪标的指数“中证北京 50 指数”，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，因此，本基金的业绩表现与中证北京 50 指数的表现密切相关。同时，本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于高风险高收益的开放式基金。

在目前结算规则下，投资者申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；即 T 日申购的基金份额当日可卖出，T 日申购当日未卖出的基金份额，T+1 日不得卖出和赎回，T+1 日交收成功后 T+2 日可卖出和赎回。因此为投资者办理申购业务的代理券商若发生交收违约，将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资者的利益可能受到影响。

22. 本公司拥有对本基金基金份额发售公告的最终解释权。

一、基金募集的基本情况

（一）基金名称

基金名称：中信建投中证北京50交易型开放式指数证券投资基金

基金简称：中信建投北京50ETF

场内简称：北京50

基金代码：

基金认购代码：512853；基金交易代码：512850；基金申赎代码：512851

（二）基金类型和运作方式

本基金类型为股票型、指数型证券投资基金，运作方式为交易型开放式。

（三）存续期限

不定期。

（四）基金份额发售面值

1.00 元人民币。

（五）募集目标

本基金不设募集规模上限。

（六）募集对象

本基金募集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、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者以及法律法

规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

(七) 基金份额发售机构

1、发售协调人

中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

客户服务电话：95587、400-8888-108

网址：www.csc108.com

2、网下现金发售和网下股票发售直销机构

中信建投基金管理有限公司

住所：北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街 2 号凯恒中心 B 座 17、19 层

法定代表人：蒋月勤

传真：010-59100298

联系人：贾欣欣

客户服务电话：4009-108-108

网址：www.cfund108.com

3、网下现金和网下股票发售代理机构

(1) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

客户服务电话：95587、400-8888-108

网址：www.csc108.com

(2) 中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦

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：张佑君

电话：010-60833722

传真：010-60833739

联系人：陈忠

网址：www.cs.ecitic.com

客户服务电话：95548

(3) 中信证券（山东）有限责任公司

住所：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

网址：www.citicssd.com

客户服务电话：95548

(4) 东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

电话：021-20333333

传真：021-50498825

联系人：王一彦

网址：www.longone.com.cn

客户服务电话：95531、400-888-8588

(5) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

办公地址：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：陈共炎

电话：010-66568430

传真：010-66568990

联系人：田薇

网址：www.chinastock.com.cn

客户服务电话：4008-888-888 或 95551

4、网上现金发售代理机构

本基金的场内发售机构为具有基金代销资格的上海证券交易所会员单位（具体名单可在上海证券交易所网站查询）。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（八）基金募集期

本基金募集期为2018年7月2日至2018年8月31日；如需延长，最长不超过自基金份额发售之日起的三个月。其中，网下现金认购的日期为2018年7月2日至2018年8月31日，网下股票认购的日期为2018年7月2日至2018年8月31日，网上现金认购的日期为2018年8月29日至2018年8月31日。如上海证券交易所对网上现金认购时间做出调整，我司将相应调整并及时公告。

基金管理人可根据认购的情况适当延长发售时间，但最长不超过法定募集期；同时也可根据认购和市场情况提前结束发售，如发生此种情况，基金管理人将会另行公告。另外，如遇突发事件，以上基金募集期的安排也可以适当调整。

二、发售方式及相关规定

（一）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。

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利用上海证券交易所网上系统以现金进行认购。

网下现金认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金进行认购。

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认购。

（二）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、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构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。

（三）认购费用

本基金的认购费用由投资者承担，认购费率如下表所示：

认购份额（份）	认购费率
100 万（含）以上	每笔 1000 元
大于等于 50 万，小于 100 万	0.4%
小于 50 万	0.8%

基金管理人办理网下现金认购和网下股票认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构，按照不高于 0.80% 的标准收取一定的佣金。

认购费用不列入基金财产，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。

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。

（四）认购份额的计算

1、网上现金认购

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、认购金额的计算公式为：

$$\text{认购佣金} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times \text{佣金比率}$$

（或若适用固定费用的，认购佣金=固定费用）

$$\text{认购金额} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times (1 + \text{佣金比率})$$

（或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用）

认购佣金由发售代理机构在投资者认购确认时收取，投资者需以现金方式交纳认购佣金。

例：某投资者通过网上现金认购 1,000 份本基金，假设发售代理机构确认的佣金比率为 0.8%，则需准备的资金金额计算如下：

$$\text{认购佣金} = 1.00 \times 1,000 \times 0.8\% = 8 \text{ 元}$$

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 1,000 \times (1 + 0.8\%) = 1,008.00 \text{ 元}$$

即投资者需缴纳 1,008.00 元资金，方可认购到 1,000 份本基金基金份额。

2、网下现金认购

(1) 通过基金管理人进行网下现金认购的认购金额的计算：

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、认购金额的计算公式为：

$$\text{认购金额} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times (1 + \text{认购费率})$$

(或若适用固定费用的， $\text{认购金额} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} + \text{固定费用}$)

$$\text{认购费用} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times \text{认购费率}$$

(或若适用固定费用的， $\text{认购费用} = \text{固定费用}$)

$$\text{利息折算的份额} = \text{利息} / \text{认购价格}$$

认购费用由基金管理人收取，投资者需以现金方式交纳认购费用。网下现金认购款项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，其中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。

例：某投资者到基金管理人直销网点认购 100,000 份基金份额，假定认购金额产生的利息为 10 元，则需准备的资金金额计算如下：

$$\text{认购费用} = 1.00 \times 100,000 \times 0.8\% = 800 \text{ 元}$$

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 100,000 \times (1 + 0.8\%) = 100,800.00 \text{ 元}$$

$$\text{利息折算的份额} = 10 / 1.00 = 10 \text{ 份}$$

即投资人若通过基金管理人认购本基金 100,000 份，需缴纳 100,800.00 元资金，并可获得利息转换的份额 10 份。

(2) 通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算：同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

3、网下股票认购

(1) 认购份额的计算

通过基金管理人或发售代理机构进行网下股票认购的投资者，认购以单只股票股数申请，在销售机构允许的条件下，投资者可以现金或基金份额的方式支付

认购佣金。

$$\text{投资者的认购份额} = \sum_{i=1}^n (\text{第}i\text{只股票在}L\text{日的均价} \times \text{有效认购数量}) / 1.00$$

若投资者以现金方式支付认购佣金，则需缴纳的认购佣金为：认购佣金=认购价格×认购份额×佣金比例

若投资者以基金份额方式支付认购佣金，则其需缴纳的认购佣金和可得到的基金份额如下：

$$\text{认购佣金} = \text{认购份额} / (1 + \text{佣金比例}) \times \text{佣金比例}$$

$$\text{净认购份额} = \text{认购份额} - \text{认购佣金}$$

以基金份额方式支付的认购佣金的计算保留到整数位，小数部分舍去。

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) L 日为网下股票认购期最后一日。

3) “第 i 只股票在 L 日的均价”由基金管理人根据证券交易所的 L 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 L 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 L 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，则由于投资者获得了相应的权益，基金管理人将按如下方式对该股票在 L 日的均价进行调整：

①除息：调整后价格= L 日均价-每股现金股利或股息

②送股：调整后价格= L 日均价/ $(1 + \text{每股送股比例})$

③配股：调整后价格= $(L$ 日均价+配股价 \times 配股比例) $/ (1 + \text{每股配股比例})$

④送股且配股：调整后价格= $(L$ 日均价+配股价 \times 配股比例) $/ (1 + \text{每股送股比例} + \text{每股配股比例})$

⑤除息且送股：调整后价格= $(L$ 日均价-每股现金股利或股息) $/ (1 + \text{每股送股比例})$

⑥除息且配股：调整后价格= $(L$ 日均价+配股价 \times 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 = (L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)

4) “有效认购数量”是指由基金管理人确认的并由登记机构据此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为：

$$q^{\max} = (\text{Cash} + \sum_{j=1}^n p_j q_j) \times 105\% \times w / p$$

q^{\max} 为限制认购规模的单只个股最高可确认的认购数量， Cash 为网上现金认购和网下现金认购的合计申请数额， $p_j q_j$ 为除限制认购规模的个股和基金管理人全部或部分临时拒绝的个股以外的其他个股L日均价和认购申报数量乘积， w 为该股按均价计算的其在L日中证北京50指数中的权重（认购期间如有中证北京50指数调整公告，则基金管理人根据公告调整后的成份股名单以及中证北京50指数编制规则计算调整后的中证北京50指数构成权重，并以其作为计算依据）， p 为该股在L日的均价。

如果投资者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，则按照各投资者的认购申报数量同比例收取。

②若某一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发生司法执行，则基金管理人将根据登记机构发送的解冻数据对投资者的有效认购数量进行相应调整。

例：某投资者持有中证北京 50 指数成份股中股票 A 和股票 B 各 10,000 股和 20,000 股，至某发售代理机构网点认购本基金，选择以现金支付认购佣金。认购期最后一日股票 A 和股票 B 的均价分别 12.50 元和 6.50 元，基金管理人确认的有效认购数量为 10,000 股股票 A 和 20,000 股股票 B，发售代理机构确认的佣金比率为 0.80%，则其可得到的基金份额和需缴纳的认购佣金如下：

$$\text{认购份额} = (10,000 \times 12.50) / 1.00 + (20,000 \times 6.50) / 1.00 = 255,000.00 \text{ 份}$$

$$\text{认购佣金} = 1.00 \times 255,000 \times 0.80\% = 2,040.00 \text{ 元}$$

即投资者可认购到 255,000 份本基金份额，并需另行支付 2,040.00 元的认购佣金。

例：续前例，假设该投资者以基金份额的方式缴纳认购佣金，则投资者最终可得净认购份额为：

认购份额 = $(10,000 \times 12.50) / 1.00 + (20,000 \times 6.50) / 1.00 = 255,000.00$ 份

认购佣金 = $255,000 / (1 + 0.80\%) \times 0.80\% = 2,023.00$ 份

净认购份额 = $255,000.00 - 2,023.00 / 1.00 = 252,977.00$ 份

即该投资者最终可认购到 252,977.00 份基金份额。

(2) 特殊情形

1) 已公告的将被调出中证北京 50 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) 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。

三、投资者开户

投资者认购本基金时需具有上海证券账户，上海证券账户是指上海证券交易所 A 股账户或上海证券交易所基金账户。

一、如投资者需新开立上海证券账户，则应注意：

1、上海证券交易所基金账户只能进行现金认购和二级市场交易；如投资者需要使用中证北京 50 指数成份股中的上海证券交易所上市股票进行网下股票认购或者进行基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户；如投资者需要使用中证北京 50 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，则应同时开立上海证券账户和深圳证券交易所 A 股账户。

2、开户当日无法办理指定交易，建议投资者在进行认购前至少 2 个工作日办理开户手续。

二、如投资者已开立上海证券账户，则应注意：

1、如投资者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者当日无法进行认购，建议投资者在进行认购的1个工作日前办理指定交易或转指定交易手续。

四、网上现金认购

1、认购时间：2018年8月29日—2018年8月31日上午9:30—11:30和下午13:00—15:00。如上海证券交易所对网上现金认购时间做出调整，我司将相应调整并及时公告。

2、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须为1000份或其整数倍，最高不得超过99,999,000份。投资者应以上海证券账户认购。投资者可多次认购，累计认购份额不设上限。

3、认购手续：投资者直接通过发售代理机构办理认购。

(1) 开立上海证券交易所A股账户或证券投资基金账户。

(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。

五、网下现金认购

(一) 直销机构

1、认购时间：2018年7月2日—2018年8月31日9:30—17:00（周六、周日及法定节假日不营业），具体业务办理时间由基金管理人确定。

2、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，每笔认购份额须为1000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5万份以上（含5万份）。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。

3、个人投资者在基金管理人直销中心办理基金认购手续时需提供下列资料：

(1) 填妥由本人、代办人或监护人签字的《账户类业务申请表(个人)》；

(2) 出示本人有效身份证件并留存由本人或监护人签字的复印件（如为身份证，需正反两面复印件）；委托他人办理的，须同时出示授权委托书及代办人有效身份证件并留存由代办人签字的复印件。

投资人如未满十六周岁，须同时出示未成年人本人及其监护人的身份证件或户口簿以及能证明监护与被监护关系的有效证件原件并留存由监护人签字的复印件，以及公司以谨慎原则认为需要提供的其他文件或证件。

(3) 出示银行活期存折或银行卡并留存由本人或监护人签字的复印件；

注：银行账户是指投资人开户时预留的认购本基金的汇款账户，银行账户名称必须同客户基金账户名称一致。

(4) 填妥由本人或代办人或监护人签字的《投资人权益须知》、《投资者风险承受能力问卷（自然人）》和《个人税收居民身份声明文件》；

(5) 上海证券交易所 A 股账户开户证明或上海证券交易所证券投资基金账户开户证明复印件。

(6) 投资者开户证券公司营业部的交易单元号；

(7) 填妥的《中信建投基金管理有限公司 ETF 基金网下认购业务申请表》；

(8) 盖银行受理章的汇款凭证回单原件或复印件；

(9) 本公司直销中心要求提供的其他有关材料。

4、机构投资者在基金管理人直销中心办理基金认购手续时需提供下列资料：

(1) 普通法人企业办理基金交易账户和基金账户开户申请时须提交的材料：

1) 企业法人提交加盖单位公章的企业营业执照复印件及副本复印件；事业法人、社会团体或其他组织提供民政部门或主管部门颁发的加盖公章的注册登记证书复印件。开户单位为分支机构的，应提交法人授权的书面证明。

2) 组织机构代码证副本（如有）复印件及税务登记证副本（如有）复印件。

3) 机构资质证明文件。

4) 指定银行账户《开户许可证》或指定银行出具的开户证明复印件。

5) 加盖公章和法定代表人签章或负责人签章的《直销业务机构授权委托书》。如为法定代表人授权代表签章，则须有法定代表人对该授权代表的授权委托书复

印件。

6) 法定代表人有效身份证件正反面复印件。

7) 经办人有效身份证件正反面复印件。

8) 填妥并加盖公章的《账户业务申请表(机构)》、《投资人权益须知》、《预留印鉴卡》、《传真交易协议书》(如需开通请填写)。

9) 上海证券交易所 A 股账户开户证明或证券投资基金账户开户证明复印件, 及投资者开户证券公司营业部的交易单元号。

10) 填妥并加盖公章或预留印鉴的《投资者风险承受能力问卷(机构版)》。

11) 非金融机构, 需提供填妥并加盖公章或预留印鉴的《机构税收居民身份声明文件(非金融机构客户填写)》、《控制人税收居民身份声明文件(消极非金融机构客户填写)》。

12) 满足上述第 11) 项《机构税收居民身份声明文件》说明中的“金融机构”条件的机构, 需提供“金融许可证”。

13) 填妥并加盖公章的《非自然人客户受益所有人调查表》。

14) 填妥并提供所列内容, 并加盖公章《非自然人客户身份识别材料列表(不包括 CRS)》

(2) 金融产品或其他机构办理基金交易账户和基金账户开户申请时须提交的材料:

1) 托管类资产开户, 指证券公司、基金公司等金融机构为其管理的客户资产管理计划开户, 一般由资产合同等相关法律文件内所规定的账户办理方负责开立, 如无规定则遵从相关法规规定办理。

A、投资管理人负责开立, 需提供上述普通法人机构资料, 包含:

a、企业法人提交加盖单位公章的企业营业执照复印件及副本复印件; 事业法人、社会团体或其他组织提供民政部门或主管部门颁发的加盖公章的注册登记证书复印件。开户单位为分支机构的, 应提交法人授权的书面证明。

b、组织机构代码证副本(如有)复印件及税务登记证副本(如有)复印件。

c、机构资质证明文件。

d、指定银行账户《开户许可证》或指定银行出具的开户证明复印件。

e、加盖公章和法定代表人签章或负责人签章的《直销业务机构授权委托书》。

如为法定代表人授权代表签章，则须有法定代表人对该授权代表的授权委托书复印件。

f、法定代表人有效身份证件正反面复印件。

g、经办人有效身份证件正反面复印件。

h、填妥并加盖公章的《账户业务申请表(产品)》、《投资人权益须知》、《预留印鉴卡》、《传真交易协议书》(如需开通请填写)。

i、上海证券交易所及深圳证券交易所 A 股账户(如需)开户证明或证券投资基金账户开户证明复印件，及投资者开立证券资金账户的证券公司营业部的交易单元号或投资者独立租用证券公司的专用交易单元号。

j、填妥并加盖公章或预留印鉴的《投资者风险承受能力问卷(机构版)》。

k、非金融机构，需提供填妥并加盖公章或预留印鉴的《机构税收居民身份声明文件(非金融机构客户填写)》、《控制人税收居民身份声明文件(消极非金融机构客户填写)》。

l、满足上述第 11) 项《机构税收居民身份声明文件》说明中的“金融机构”条件的机构，需提供“金融许可证”。

m、填妥并加盖公章的《非自然人客户受益所有人调查表》。

n、填妥并提供所列内容，并加盖公章《非自然人客户身份识别材料列表(不包括 CRS)》

在此基础上还需提供：

1) 资产管理合同或资产托管协议的首末页复印件。

2) 向证监会、基金业协会等监管机构报备的书面文件材料或相关证明文件复印件。

B、托管人负责开立，除以上材料外需补充：

a、托管人和投资管理人的营业执照副本复印件，或民政部门等颁发的注册登记书复印件。

b、托管人出具的《直销业务机构授权委托书》(加盖公章和法定代表人签章或负责人签章)，如为法定代表人授权代表签章，则须有法定代表人对该授权代表的授权委托书复印件。

c、托管人出具的《预留印鉴卡》。

- d、托管人出具的经办人有效身份证件原件及正反面复印件。
- e、托管人出具的法定代表人或负责人有效身份证件正反面复印件。

(3) 社保组合开户资料

社保组合开户，指由该社保基金的托管人负责开户，在上述托管类资产开户资料基础上，还需提供：

社保理事会确定管理人及相应投资组合的确认函复印件；或社保理事会分别与托管人、投管人分别签署的托管合同和投资管理合同首末页（加盖托管人或投管人公章）。

(4) 其他机构（合格境外机构开户 QFII），应提供监管机构颁发的 QFII 证券投资业务许可证的复印件；QFII 机构提供的授权书，其中应包含授权对象、授权对象可代理的业务、授权期限等内容，由 QFII 机构的负责人签名确认；监管机构出具的关于托管机构 QFII 托管人资格的批复复印件。

- (5) 填妥的《中信建投基金管理有限公司 ETF 基金网下认购业务申请表》；
- (6) 盖银行受理章的汇款凭证回单复印件；
- (7) 本公司直销中心要求提供的其他有关材料。

5、投资者办理认购前应将足额资金汇入中信建投基金管理有限公司直销专户。

账户名称：中信建投基金管理有限公司

开户银行：中国工商银行股份有限公司北京东四支行

银行账号：0200 0041 2902 7314 037

6、注意事项：

(1) 投资者在认购时不能使用中信建投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 股账户或证券投资基金账户。

(2) 若个人投资者的认购资金在认购申请当日 17:00 之前未到达本公司指定的直销专户，则当日提交的申请被认定为无效认购而自动取消。

(3) 投资者若未按上述规定划付款项，造成认购无效的，中信建投基金管理有限公司不承担任何责任。

(二) 发售代理机构

1、认购时间：2018 年 7 月 2 日—2018 年 8 月 31 日 9:30—17:00（周六、周

日及法定节假日不营业)，具体业务办理时间由各发售代理机构的规定为准。

2、**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，每笔认购份额须为 1000 份或其整数倍。投资者可以多次认购，累计认购份额不设上限。具体请遵循各发售代理机构的规定。

3、**认购手续：**投资者直接通过发售代理机构办理认购。

(1) 开立上海证券交易所 A 股账户或证券投资基金账户。

(2) 在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

(3) 投资者填写认购委托单，同时填写委托该发售代理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。

六、网下股票认购

(一) 直销机构

1、**认购时间：**2018 年 7 月 2 日—2018 年 8 月 31 日，具体业务办理时间由基金管理人确定。

2、**认购限额：**网下股票认购以单只股票股数申报，用以认购的股票必须是中证北京 50 指数成份股和已公告的备选成份股（具体名单以本基金份额发售公告为准）。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。投资者应以 A 股账户认购，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：**

(1) 投资者在基金管理人直销中心办理基金认购手续前，须办理基金交易账户和基金账户开户申请，所需材料同网下现金认购。

(2) 如投资者以中证北京 50 指数成份股中的上海证券交易所上市股票认购本基金，需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。

(3) 如投资者以中证北京 50 指数成份股中的深圳证券交易所上市股票认购本基金，需开立上海证券交易所 A 股账户或证券投资基金账户，以及深圳证券交易所 A 股账户。

(4) 在 A 股账户中具备足够的符合要求的中证北京 50 指数成份股和已公

告的备选成份股。

(5) 投资者填写《中信建投基金管理有限公司 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上海证券交易所相关规定进行股票认购，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；个人投资者还需按照基金管理人要求提供拟认购股票为流通股票的证明材料。

(二) 发售代理机构

1、认购时间：2018 年 7 月 2 日—2018 年 8 月 31 日，具体业务办理时间由各发售代理机构的规定为准。

2、认购限额：网下股票认购以单只股票股数申报，用以认购的股票必须是中证北京 50 指数成份股和已公告的备选成份股（具体名单以本基金份额发售公告为准）。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。

投资者可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

七、清算与交割

1、通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资者所有，其中利息转份额以基金管理人的记录为准；网上现金认购及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本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；投资者以股票认购的，认购股票按交易所及登记机构的规则予以冻结与过户，该股票自认购日至登记机构进行股票过户日的期间所产生的权益归认购投资者本人所有。

2、本基金权益登记由登记机构在基金募集结束后完成。

八、基金的验资与基金合同的生效

本基金自基金份额发售之日起三个月内，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，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。

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，网下股票认购募集的股票予以冻结，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

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 日内退还投资者已缴纳的款项，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，应按交易所及登记机构的规则予以解冻；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及发售代理机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和发售代理机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

九、本次募集有关当事人或中介机构

（一）基金管理人

名称：中信建投基金管理有限公司

住所：北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17、19层

法定代表人：蒋月勤

设立日期：2013年9月9日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可（2013）1108号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币30000万元

存续期限：永久存续

联系电话：4009-108-108

（二）基金托管人

名称：招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

成立时间：1987 年 4 月 8 日

法定代表人：李建红

注册资本：人民币 252.20 亿元

联系人：张燕

联系电话：0755—83199084

（三）基金份额发售机构

本基金的发售机构名单详见本基金发售公告“一、基金募集的基本情况（七）基金份额发售机构”部分的相关内容。

本基金募集期内，本公司可能增加新的发售机构，并另行公告。投资人可留意相关公告信息或拨打本公司客户服务电话进行查询。

（四）登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所、办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：朱立元

电话：010-58598839

传真：010-58598907

（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：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 层

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：黎明、陆奇

联系人：陆奇

（六）审计基金资产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系人：张勇

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

经办注册会计师：许康玮、张勇

十、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，但是募集期结束前已公告的将被调出中证北京 50 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，并在网下股票认购日前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。

证券代码	证券名称	证券代码	证券名称
600008	首创股份	000401	冀东水泥
600015	华夏银行	000402	金融街
600037	歌华有线	000725	京东方 A
600062	华润双鹤	000729	燕京啤酒
600085	同仁堂	000839	中信国安

600118	中国卫星	000860	顺鑫农业
600166	福田汽车	000959	首钢股份
600258	首旅酒店	002038	双鹭药业
600266	北京城建	002065	东华软件
600271	航天信息	002371	北方华创
600376	首开股份	002410	广联达
600435	北方导航	002439	启明星辰
600582	天地科技	002573	清新环境
600715	文投控股	300055	万邦达
600859	王府井	300058	蓝色光标
600977	中国电影	300166	东方国信
601169	北京银行	300182	捷成股份
601588	北辰实业	300251	光线传媒
601949	中国出版	300271	华宇软件
601992	金隅集团	300287	飞利信
603000	人民网	300315	掌趣科技
603025	大豪科技	300324	旋极信息
603533	掌阅科技	300367	东方网力
603888	新华网	300383	光环新网
000008	神州高铁	300418	昆仑万维

中信建投基金管理有限公司

二零一八年六月二十八日