

山西证券股份有限公司

山西证券中证红利潜力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：山西证券股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

二零一九年十二月

目录

重要提示.....	2
一、本次基金募集基本情况	6
二、认购方式与相关规定	9
三、投资者开户	14
四、本基金的认购程序	15
五、清算与交割	22
六、基金的验资与基金合同生效	24
七、本次发售当事人或中介机构	25
八、网下股票认购清单	28

重要提示

1、山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2019年9月2日证监许可[2019]1596号文注册。中国证监会对本基金的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

2、本基金类别为股票型证券投资基金，运作方式为交易型开放式。

3、本基金的基金管理人为山西证券股份有限公司（以下简称“本公司”），基金托管人为中国银行股份有限公司，本基金登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4、本基金的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和特定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2019年12月23日至2020年1月9日公开发售。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。其中，网上现金认购的日期为2020年1月7日至2020年1月9日，网下现金认购的日期为2019年12月23日至2020年1月9日，网下股票认购的日期为2019年12月23日至2020年1月9日。如上海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。基金管理人可以根据募集情况适当缩短或延长本基金的募集期限并及时公告。本基金的募集期限不超过3个月，自基金份额开始发售之日起计算。

6、本基金首次募集不设规模上限。

7、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用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及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及其指定的发售代理机构以股票进行的认购。

8、投资人认购本基金时需具有上海证券交易所A股账户或证券投资基金账户。

9、本基金基金份额初始面值为人民币1.00元，认购价格为人民币1.00元。

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。投资人可多次认购，累计认购份额不设

上限。

网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须 1000 份或其整数倍；投资人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），投资人可多次认购，累计认购份额不设上限，但除基金合同另有约定外。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

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标的指数成份股和已公告的备选成份股（具体名单见本公告“八、网下股票认购清单”）。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。

11、投资者在认购本基金时，需按基金管理人及发售代理机构的规定，备足认购资金/股票，办理认购手续。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。网下现金认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。网下股票认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

12、投资者不得非法利用他人账户或资金进行认购，也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。

13、投资者应保证用于认购的资金来源合法，投资者应有权自行支配，不存在任何法律上、合约上或其他障碍。

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金额的确认情况，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登记机构予以冻结，于基金募集期结束后过户至预先开立的专门账户。

16、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等允许其认购可能影响基金份额持有人利益的个股，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。

17、基金合同生效后，符合基金上市交易条件的，基金管理人可依据《上海证券交易所证券投资基金上市规则》，向上海证券交易所申请基金份额上市。上市交易的有关事项将另行公告。

18、本公告仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明。投资人若欲了解本基金的详细情况，请阅读本公司于 2019 年 12 月 20 日在《证券时报》上刊登的《山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》及《山西证券中证红利潜力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》。《山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金托管协议》、《山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及本公告将同时发布在本公司公募基金业务网站 (<http://publiclyfund.sxzq.com:8000/>) 和中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>) 上，投资人亦可通过本公司公募基金业务网站和中国证监会基金电子披露网站了解本基金募集相关事宜。

19、各发售代理机构办理认购业务的办理网点、办理日期和时间等事项参照各发售代理机构的具体规定。

20、投资人可拨打本公司的客户服务电话 95573 或其他销售机构的客户服务电话咨询认购事宜。

21、基金管理人可综合各种情况对基金份额的发售安排做适当调整并及时公告。本公司拥有对本基金基金份额发售公告的最终解释权。

22、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机构名单，报上海证券交易所，经有关部门认可后，由基金管理人公告。本基金上市后，未登记在申购赎回代理机构的投资者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机构。

23、风险揭示

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。投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，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，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。同时由于本基金是交易型开放式指数证券投资基金，特定风险还包括：标的指数的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、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、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、申购赎回清单差错风险、第三方机构服务的风险等。本基金的具体风险描述详见招募说明书“风险揭示”章节。

本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，同时本基金为交易型开放式指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

根据基金合同的相关规定，本基金每日可设定申购份额、赎回份额上限，对于超出设定份额上限的申购、赎回申请，基金管理人有权予以拒绝。

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，即在目前结算规则下，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。因此投资人办理申购业务的代理机构若发生交收违约，将导致投资人不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资人的利益可能受到影响。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书、基金产品资料概要及基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，全面认识本基金产品的风险收益特征，应充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险，由投资者自行承担。

本基金初始募集面值为人民币 1.00 元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于初始面值，本基金投资者有可能出现亏损。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

一、本次基金募集基本情况

（一）基金名称

基金全称：山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金

基金场内简称：山证红利

认购代码：515573

（二）基金的类别

股票型证券投资基金

（三）基金的运作方式

交易型开放式

（四）基金的标的指数

本基金标的指数为中证红利潜力指数。

（五）基金的最低募集份额总额

本基金募集份额总数不低于 2 亿份，募集金额总额（含网下股票认购所募的股票按基金合同约定的估值方法计算的价值）不低于 2 亿元人民币。

（六）基金份额初始面值和认购价格

本基金基金份额初始面值为人民币 1.00 元，认购价格为人民币 1.00 元。

（七）基金存续期限

不定期

（八）基金的投资目标

紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

（九）标的指数与业绩比较基准

本基金的标的指数为中证红利潜力指数。

本基金业绩比较基准为标的指数，即中证红利潜力指数收益率。

（十）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和特定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。

（十一）基金份额发售机构

1、发售协调人

海通证券股份有限公司

2、网下现金和网下股票发售直销机构

山西证券股份有限公司直销柜台

3、网下现金和网下股票发售代理机构

山西证券股份有限公司营业部

4、网上现金发售代理机构

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员可通过上海证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。具体名单可在上海证券交易所网站查询，本基金管理人将不就此事项进行公告。

5、基金管理人可以根据情况变化增加或减少发售代理机构，并在管理人网站公示。发售代理机构可以根据情况增加或减少其销售城市、网点。

（十二）募集时间安排与基金合同生效

1、本基金的募集期为自基金份额发售之日起最长不得超过3个月。

2、本基金自2019年12月23日至2020年1月9日公开发售。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。其中，网上现金认购的日期为2020年1月7日至2020年1月9日，网下现金认购的日期为2019年12月23日至2020年1月9日，网下股票认购的日期为2019年12月23日至2020年1月9日。如上海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。基金管理人可以根据募集情况适当缩短或延长本基金的募集期限并及时公告。

3、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按基金合同约定的估值方法计算的价值）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，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。

4、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，网下股票认购所募集的股票由登记机构予以冻结，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

5、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：以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；在基金募集期限届满后30日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息，同时将已冻结的股票解冻，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；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。

二、认购方式与相关规定

(一) 投资人应当在基金管理人及其指定发售代理机构办理基金发售业务的营业场所，或者按基金管理人或发售代理机构提供的方式办理基金份额的认购。

(二) 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用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及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及其指定的发售代理机构以股票进行的认购。

(三) 最低认购限额

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。投资人可多次认购，累计认购份额不设上限。

网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须 1000 份或其整数倍；投资人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），投资人可多次认购，累计认购份额不设上限，但除基金合同另有约定外。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

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标的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。

(四) 认购费用

本基金的认购采用份额认购的原则。认购费用由投资人承担，认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等发售期间发生的各项费用。

认购费率如下表：

认购份额 (M)	认购费率
M < 50 万份	0.80%

50 万份 ≤ M < 100 万份	0.40%
M ≥ 100 万份	1000 元/笔

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。基金管理人在投资者提交认购申请时以现金方式向投资者收取认购费用。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。投资者申请重复认购的，须按每笔认购申请所对应的费率档次分别计费。

(五) 认购金额的计算：

1、通过发售代理机构进行网上现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购佣金和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向投资人收取，投资人需以现金方式交纳认购佣金。

例：某投资者通过某发售代理机构网点认购 10,000.00 份本基金基金份额，假设该发售代理机构确认的佣金比率为 0.80%，则需准备的认购资金金额计算如下：

$$\text{认购佣金} = 10,000.00 \times 1.00 \times 0.80\% = 80.00 \text{ 元}$$

$$\text{认购金额} = 10,000.00 \times 1.00 \times (1 + 0.80\%) = 10,080.00 \text{ 元}$$

即投资者需准备 10,080.00 元资金，方可认购到 10,000.00 份本基金基金份额。

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

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

(或若适用固定费用的，认购费用=固定费用)

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

(或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用)

$$\text{利息折算份额} = \text{认购金额产生的利息} / \text{认购价格}$$

$$\text{认购份额总额} = \text{认购份额} + \text{利息折算份额}$$

认购费用由基金管理人向投资人收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。

例：某投资者到本公司直销网点认购 100,000 份本基金基金份额，假设认购资金募集期间产生的利息为 2.00 元，则需准备的认购资金金额及募集期间利息折算的份额计算如下：

认购费用=1.00×100,000×0.80%=800.00 元

认购金额=1.00×100,000×(1+0.80%)=100,800.00 元

利息折算份额=2.00/1.00=2 份

即投资者通过本公司直销网点认购本基金 100,000 份，需准备 100,800.00 元资金，加上募集期间利息折算的份额后一共可以得到 100,002 份基金份额。

3、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。

4、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报，用以认购的股票必须是标的指数成份股和已公告的备选成份股。

认购份额的计算公式：

投资者的认购份额= $\sum_{i=1}^n$ （第 i 只股票在网下股票认购期最后一日的均价 × 有效认购数量/基金份额发售面值）

其中，

(1) i 代表投资者提交认购申请的第 i 只股票，n 代表投资人提交的股票总只数，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，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网下股票认购期最后一日的均价进行调整：

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

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）

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)

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)

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)

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)

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)

(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。

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：

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

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在网下股票认购期最后一日均价和认购申报数量乘积；

w 为该股按均价计算的其在网下股票认购期最后一日在标的指数中的权重（认购期间如有标的指数调整公告，则基金管理人根据公告调整后的成份股名单以及标的指数编制规则计算调整后的标的指数构成权重，并以其作为计算依据）；

p 为该股在网下股票认购期最后一日的均价。

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。

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发送的解冻数据对投资者的有效认购数量进行相应调整。

(5) 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等允许其认购可能影响基金份额持有人利益的个股，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，如标的指数成分股出现调整，则调入名单中的股票也将纳入认购清单。

(6) 特别提示

投资人应根据法律法规及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。

(六) 募集期认购资金、股票及利息、股票权益的处理方式

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登记机构予以冻结，于基金募集期结束后过户至预先开立的专门账户。

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专户前产生的利息，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的冻结期间所产生的权益归投资者所有。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

三、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 股账户或证券投资基金账户（以下简称“上海证券账户”）。

已有上海 A 股账户或证券投资基金账户的投资人不必再办理开户手续。

尚无上海 A 股账户或证券投资基金账户的投资人，需在认购前持本人身份证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上海 A 股账户或证券投资基金账户的开户手续。有关上海 A 股账户或证券投资基金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：

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，如投资人需要使用中证红利潜力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 A 股账户；如投资人需要使用中证红利潜力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。

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

2、如投资人已开立上海证券账户，则应注意：

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。

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人则无需办理指定交易。

四、本基金的认购程序

（一）网上现金认购

1、认购时间：

2020年1月7日至2020年1月9日上午9:30至11:30和下午13:00至15:00。如上海证券交易所对网上现金认购时间作出调整，我司将作出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需为1,000份或其整数倍，最高不得超过99,999,000份。投资人可多次认购，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手续，并备足认购资金。

（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；

（4）在基金合同生效后，投资者可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

具体时间和认购手续以上海证券交易所和发售代理机构的相关规定为准。

（二）网下现金认购

1、直销机构

（1）认购时间：

2019年12月23日至2020年1月9日的9:30至17:00（周六、周日及法定节假日不受理）。

（2）认购限额：

网下现金认购以基金份额申请。投资人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），投资人可多次认购，累计认购份额不设上限，但除基金合同另有约定外。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

(3) 认购手续：投资者可以到基金管理人直销柜台办理本基金的认购手续，并备足认购资金。

A 个人投资者办理网下现金认购手续需提供的资料：

1) 身份证件原件（包括：身份证、护照等）及复印件（正反面）；
2) 上海证券交易所 A 股账户卡或基金账户卡，并提供有效的账户凭证，以证明所提交的有效身份证件与其开立该上海证券交易所 A 股账户或基金账户时登记的证件一致；

3) 本人的储蓄账户或银行卡原件及复印件；

4) 盖银行受理章的汇款凭证回单原件及复印件（汇款金额需包含认购费用）；

5) 填妥并签字/加盖预留印鉴的《基金网下认购业务申请》；

6) 个人投资者风险承受能力调查问卷；

7) 《个人税收居民身份声明文件》；

8) 《证券投资基金投资人权益须知》；

9) 填妥的《适当性管理投资者须知》；

10) 填妥的《投资者基本信息表（个人）》；

11) 《山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金风险揭示书》；

12) 《客户风险承受能力问卷（适用于自然人客户）》（如需）；

13) 《客户风险承受能力评估结果告知函》（如需）；

14) 《专业投资者告知及确认书》（如需）；

15) 《专业投资者申请书》（如需）；

16) 《专业投资者知识测试题》（如需）；

17) 管理人要求的其他材料；

B 机构投资者办理网下现金认购手续需提供的资料：

1) 企业营业执照或注册登记证书副本、组织机构代码证和税务登记证、经营证券、基金、期货业务的许可证、经营其他金融业务的许可证、基金会法人登记证明、私募基金管理人登记材料等身份证明材料复印件；

2) 法定代表人的有效身份证件正反面复印件；

3) 授权经办人的有效身份证件正反面复印；

4) 预留银行账户的《开户许可证》或《开立单位银行结算账户申请书》等

银行账户证明文件；

- 5) 上海 A 股账户或证券投资基金账户原件及复印件；
- 6) 法定代表人签章并加盖单位公章的《基金业务授权委托书》；
- 7) 《预留印鉴卡》；
- 8) 填妥并签字/加盖预留印鉴的《基金网下认购业务申请》；
- 9) 企业投资者风险承受能力调查问卷；
- 10) 加盖银行受理章的银行付款凭证回单原件及复印件；
- 11) 填妥的《投资者基本信息表（机构）》；
- 12) 填妥的《适当性管理投资者须知》；
- 13) 《非自然人客户受益所有人情况表》；
- 14) 《山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金风险揭示书》；
- 15) 《控制人税收居民身份声明文件》（如需）；
- 16) 《机构税收居民身份声明文件》（如需）；
- 17) 《专业投资者知识测试题》（如需）；
- 18) 《专业投资者申请书》（如需）；
- 19) 《专业投资者告知及确认书》（如需）；
- 20) 《客户风险承受能力评估结果告知函》（如需）；
- 21) 《客户风险承受能力问卷（适用于机构客户）》（如需）；
- 22) 《传真交易协议书》（如需）；
- 23) 管理人要求的其他材料；

（4）认购资金的划拨：

投资者办理本基金的认购需将足额认购资金汇入本公司以下基金直销资金账户：

账户名称：山西证券股份有限公司

开户银行：交通银行山西省分行营业部

银行账号：141000601018170427503

（5）在基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况

（6）注意事项：

投资者在认购本基金时不能使用其拥有的山西证券股份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。投资者须注明认购的基金份额名称或基金代码；

(7) 以下情形将被认定为无效认购：

①投资者认购资金在认购申请单日 17:00 之前未到达本公司指定的基金直销资金账户，则当日提交的申请无效；

②投资者已在规定时间内划付资金，但逾期未办理认购手续的；

③投资者已划付的认购资金少于其申请的认购金额的；

④本公司确认的其它无效资金。

(8) 投资者因上述情形造成认购无效的，本公司及直销专户的开户银行不承担任何责任。

2、发售代理机构

(1) 认购时间：

2019年12月23日至2020年1月9日，具体业务办理时间由发售代理机构确定。

(2) 认购限额：

网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须 1000 份或其整数倍，投资人可多次认购，累计认购份额不设上限，但除基金合同另有约定外。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。

(3) 认购手续：投资人在认购本基金时，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。

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) 投资者投资人填写认购委托单，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。

具体规定，投资者请参照各发售代理机构销售网点规定为准。在基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

(三) 网下股票认购

1、直销机构

(1) 认购时间：

2019年12月23日至2020年1月9日上午9:30至11:30和下午13:00至15:00（周六、周日及节假日不受理）

（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标的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。

（3）认购手续：投资者可以到基金管理人直销柜台办理本基金的认购手续。并备足认购股票。

A 个人投资者办理网下股票认购手续需提供的资料：

- 1) 身份证件原件（包括：身份证、护照等）及复印件（正反面）；
- 2) 上海证券交易所A股账户卡或基金账户卡，并需提供有效的账户凭证，以证明所提交的有效身份证件与其开立该上海证券交易所A股账户或基金账户时登记的证件一致；
- 3) 本人的储蓄账户或银行卡原件及复印件；
- 4) 盖银行受理章的汇款凭证回单原件及复印件（汇款金额需包含认购费用）；
- 5) 填妥并签字/加盖预留印鉴的《基金网下认购业务申请》；
- 6) 个人投资者风险承受能力调查问卷；
- 7) 《个人税收居民身份声明文件》；
- 8) 《证券投资基金投资人权益须知》；
- 9) 填妥的《适当性管理投资者须知》；
- 10) 填妥的《投资者基本信息表（个人）》；
- 11) 《山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金风险揭示书》；
- 12) 《客户风险承受能力问卷（适用于自然人客户）》（如需）；
- 13) 《客户风险承受能力评估结果告知函》（如需）；
- 14) 《专业投资者告知及确认书》（如需）；
- 15) 《专业投资者申请书》（如需）；
- 16) 《专业投资者知识测试题》（如需）；
- 17) 管理人要求的其他材料；

B 机构投资者办理网下股票认购手续需提供的资料：

1) 企业营业执照或注册登记证书副本、组织机构代码证和税务登记证、经营证券、基金、期货业务的许可证、经营其他金融业务的许可证、基金会法人登记证明、私募基金管理人登记材料等身份证明材料复印件；

2) 法定代表人的有效身份证件正反面复印件；

3) 授权经办人的有效身份证件正反面复印；

4) 预留银行账户的《开户许可证》或《开立单位银行结算账户申请书》等银行账户证明文件；

5) 上海 A 股账户或证券投资基金账户原件及复印件；

6) 法定代表人签章并加盖单位公章的《基金业务授权委托书》；

7) 《预留印鉴卡》；

8) 填妥并签字/加盖预留印鉴的《基金网下认购业务申请》；

9) 企业投资者风险承受能力调查问卷；

10) 加盖银行受理章的银行付款凭证回单原件及复印件；

11) 填妥的《投资者基本信息表（机构）》；

12) 填妥的《适当性管理投资者须知》；

13) 《非自然人客户受益所有人情况表》；

14) 《山西证券中证红利潜力交易型开放式指数证券投资基金风险揭示书》；

15) 《控制人税收居民身份声明文件》（如需）；

16) 《机构税收居民身份声明文件》（如需）；

17) 《专业投资者知识测试题》（如需）；

18) 《专业投资者申请书》（如需）；

19) 《专业投资者告知及确认书》（如需）；

20) 《客户风险承受能力评估结果告知函》（如需）；

21) 《客户风险承受能力问卷（适用于机构客户）》（如需）；

22) 《传真交易协议书》（如需）；

23) 管理人要求的其他材料；

2、发售代理机构

(1) 认购时间：

2019 年 12 月 23 日至 2020 年 1 月 9 日，具体业务办理时间以各发售代理机

构规定为准。

(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标的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。

(3) 认购手续：投资者可以到发售代理机构办理认购手续，并备足认购股票。

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 A 股账户中具备足够的符合要求的中证红利潜力指数成份股和已公告的备选成分股。

3) 投资者填写认购委托单。申报一经确认，认购股票即被冻结。

具体规定，投资者请参照各发售代理机构销售网点规定为准。

3、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等允许其认购可能影响基金份额持有人利益的个股，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。

4、特别提示

投资人应根据法律法规及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。

五、清算与交割

(一) 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登记机构予以冻结，于基金募集期结束后过户至预先开立的专门账户。

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专户前产生的利息，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的冻结期间所产生的权益归投资者所有。

(二) 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第 4 个工作日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。

(三) T 日通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人于 T+2 日内进行有效认购款项的清算交收，将认购款项及其利息划往基金管理人预先开设的基金募集专户。其中，现金认购款项在募集期产生的利息将折算为基金份额归投资者所有，认购款项利息数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。

T 日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者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者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其预先开设的基金募集专户。

(五) 投资者通过发售代理机构办理网下股票认购的，每日日终，发售代理机构将当日的股票认购数据按投资者证券账户汇总发送给基金管理人。T 日日终 (T 日为本基金发售期最后一日)，基金管理人初步确认各成份股的有效认购数

量。T+1 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，并将深圳市场网下认购股票过户至本基金组合证券认购专户。基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的佣金，并从投资者的认购份额中扣除，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人净认购份额明细数据进行投资人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，按照交易所和登记机构的规则和流程，将投资人申请认购的股票过户到本基金的证券账户。通过发售直销机构进行网下股票认购的，遵照基金管理人及登记结算机构的相关业务规则办理。

（五）基金募集结束后，基金注册登记机构将根据相关法律法规以及业务规则和《基金合同》的约定，完成基金份额持有人的权益登记。

六、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按基金合同约定的估值方法计算的价值）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，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，网下股票认购所募集的股票由登记机构予以冻结，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

（二）基金合同不能生效时募集资金及股票的处理方式

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日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息，同时将已冻结的股票解冻，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。

七、本次发售当事人或中介机构

（一）基金管理人

名称：山西证券股份有限公司

住所及办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

成立时间：1988 年 7 月 28 日

法定代表人：侯巍

批准设立机关及批准设立文号：中国人民银行复[1988]315 号

组织形式：股份有限公司

存续期限：持续经营

注册资本：人民币 28.2873 亿元人民币

电话：(0351) 8686966

传真：(0351) 8686918

（二）基金托管人

名称：中国银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

（三）销售机构

1、发售协调人

海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

联系人：李楠

客服电话：95553

网站：www.htsec.com

2、网下现金和网下股票发售直销机构

山西证券股份有限公司直销柜台

住所及办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

董秘：王怡里

电话：0351-8686966

传真：0351-8686918

客服电话：95573

网站：www.i618.com.cn

3、网下现金发售代理机构、网下股票发售代理机构

(1) 山西证券股份有限公司营业部

住所：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

组织形式：股份有限公司

存续期间：永续经营

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686966

传真：0351-8686667

联系人：谢武兵

客服电话：95573

网站：www.i618.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规，选择其他符合要求的机构代理发售本基金，并在管理人网站公示。

4、网上现金发售代理机构

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员可通过上海证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。具体名单可在上海证券交易所网站查询，本基金管理人将不就此事项进行公告。

5、基金管理人可以根据情况变化增加或减少发售代理机构，并在管理人网站公示。发售代理机构可以根据情况增加或减少其销售城市、网点。

（四）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

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：冯天骄

电话：021-38874800

传真：021-68870311

（五）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

经办律师：刘佳、姜亚萍

联系人：刘佳

（六）审计基金财产的会计师事务所

名称：中喜会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市崇文区崇文门外大街 11 号新城文化大厦 A 座 11 层

办公地址：北京市崇文区崇文门外大街 11 号新城文化大厦 A 座 11 层

法定代表人：张增刚

电话：010-68085873

经办注册会计师：白银泉、张伟

联系人：张伟

八、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红利潜力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认购申报数量异常等允许其认购可能影响基金份额持有人利益的个股，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。募集结束前，如标的指数成分股出现调整，则调入名单中的股票也将纳入认购清单。

证券代码	股票名称	证券代码	股票名称
000002	万科A	600066	宇通客车
000333	美的集团	600104	上汽集团
000338	潍柴动力	600201	生物股份
000423	东阿阿胶	600271	航天信息
000538	云南白药	600309	万华化学
000568	泸州老窖	600389	江山股份
000581	威孚高科	600395	盘江股份
000596	古井贡酒	600519	贵州茅台
000789	万年青	600563	法拉电子
000858	五粮液	600566	济川药业
000895	双汇发展	600612	老凤祥
001979	招商蛇口	600660	福耀玻璃
002007	华兰生物	600741	华域汽车
002032	苏泊尔	600809	山西汾酒
002110	三钢闽光	600887	伊利股份
002251	步步高	600897	厦门空港
002294	信立泰	601006	大秦铁路

002304	洋河股份	601088	中国神华
002315	焦点科技	601155	新城控股
002415	海康威视	601598	中国外运
002508	老板电器	601601	中国太保
002867	周大生	601857	中国石油
300033	同花顺	603288	海天味业
300628	亿联网络	603444	吉比特
600028	中国石化	603589	口子窖

山西证券股份有限公司

2019年12月20日