

中融中证 500 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：中融基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

目 录

一、本次发售基本情况	7
二、认购方式与相关规定	9
三、投资者开户	14
四、网上现金认购的程序	14
五、网下现金认购的程序	15
六、网下股票认购的程序	17
七、清算与交割	19
八、基金资产的验资与基金合同生效	21
九、有关当事人或中介机构	21
十、网下股票认购清单	30

【重要提示】

1. 中融中证500交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集申请经中国证监会2019年7月17日证监许可〔2019〕1304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. 本基金是股票型证券投资基金，运作方式为交易型开放式。

3. 本基金的管理人为中融基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）。

4. 本基金的托管人为中国光大银行股份有限公司。

5. 本基金的基金份额登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

6. 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、机构投资者和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。

7. 本基金自2019年9月3日至2019年11月8日通过基金管理人的直销中心和发售代理机构公开发售。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。其中，网上现金认购的发售日期为2019年11月6日至2019年11月8日，通过本公司进行网下现金认购和网下股票认购的发售日期为2019年9月3日至2019年11月8日，通过发售代理机构进行网下现金认购和网下股票认购的发售日期为2019年9月3日至2019年11月8日。基金管理人可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。

8. 本基金的网上现金认购通过基金管理人指定的发售代理机构办理，发售代理机构为具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司。投资者可以通过基金管理人和发售代理机构办理网下现金认购及网下股票认购。

9. 投资者投资本基金时需具有上海证券账户，但需注意，使用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500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500指数成份股或备选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比率不超过认购份额的0.8%。

11. 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。投资人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）。投资人可以多次认购，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500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1000股，超过1000股的部分须为100股的整数倍。投资人可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

12. 本基金募集期内不设募集目标上限。

13. 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。

14. 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。

15. 投资者应保证用于认购的资金和股票来源合法，且该股票属于法律法规及交易所允许流通且可参与竞价交易的股票。对于投资者用于认购的资金和股票，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。

16. 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，投资人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。

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。

投资者应提前了解发售代理机构相关业务规则，及时查询网下股票认购申请的确认情况，敬请投资者留意相关风险。

17. 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，请阅读《中融中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。本基金的招募说明书及本公告将发布在本基金管理人网站。投资者如有疑问，请拨打本公司的客户服务电话（400 160 6000 或 010-56517299）及其他销售机构客户服务电话。

18. 基金管理人可综合各种情况依法对本基金募集安排做适当调整。

19. 各发售代理机构的代销网点以及开户、认购等事项的详细情况请向各发售代理机构咨询。

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（亦称“一级交易商”）名单，报上海证券交易所，经有关部门认可后，予以公告。本基金上市后，指定交易未在一级交易商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，须指定交易或转指定交易到一级交易商。

20. 风险提示

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

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，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。投资人在投资本基金前，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，指数复制风险、标的指数回报与行业平均回报偏离风险、标的指数变更风险、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、退市风险等本基金的特定风险等。本基金可投资股指期货。股指期货交易采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，存在潜在损失可能成倍放大的风险。

本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金（ETF），将在上海证券交易所上市。由于本基金的标的指数组合证券包含上海及深圳两个证券交易所上市的品种，本基金的申购、赎回流程与组合证券仅在上海或深圳证券交易所上市的 ETF 产品有所差异。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。因此为投资者办理申购业务的申购赎回代理机构若发生交收违约，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。投资人认购或申购基金份额时应认真阅读本招募说明书。

投资人在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同等信息披露文件，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。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。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引致的投资风险，由投资者自行负责。

一、本次发售基本情况

（一）基金的基本信息

基金名称：中融中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

场内简称：中融 500

基金认购代码：515553

一级市场申赎代码：515551

二级市场交易代码：515550

运作方式：交易型开放式

基金类别：股票型证券投资基金

存续期限：不定期

（二）基金份额初始面值、发售价格

本基金每份基金份额发售面值为 1.00 元，认购价格为 1.00 元。

（三）投资目标

本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

（四）标的指数与业绩比较基准

本基金标的指数为中证 500 指数。

本基金业绩比较基准为中证 500 指数收益率。

（五）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、机构投资者和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。

（六）基金份额发售机构

本基金募集期内，基金份额在直销机构和其他销售机构的各个网点同时公开发售。

1. 直销机构：中融基金管理有限公司。

2. 其他销售机构：销售机构名单详见本公告“九、有关当事人或中介机构”部分。募集期间，各销售机构办理认购业务的具体网点、流程、规则以及投资者需要提交的文件等信息，请参照各销售机构的规定，基金管理人

可以增减本基金的销售机构，届时以基金管理人发布的公告（若有）为准。

（七）发售时间安排

本基金募集期限不超过 3 个月，自基金份额开始发售之日起计算。

本基金自 2019 年 9 月 3 日起进行发售。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。其中，网上现金认购的发售日期为 2019 年 11 月 6 日至 2019 年 11 月 8 日，通过基金管理人进行网下现金认购和网下股票认购的发售日期为 2019 年 9 月 3 日至 2019 年 11 月 8 日，通过发售代理机构进行网下现金认购和网下股票认购的发售日期为 2019 年 9 月 3 日至 2019 年 11 月 8 日。基金管理人可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

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，并且基金份额持有人的人数不少于 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。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结算机构清算交收后至认购资金划入托管专户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资人基金份额。基金募集期间募集的股票由登记机构予以冻结，募集的股票自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认购投资人本人所有。

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当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 日内返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，发售代理机构应予以解冻。

二、认购方式与相关规定

1. 认购方式

本基金认购采取份额认购的方式。

2. 认购费率

认购费用由投资者承担，投资人可以多次认购本基金，认购费率按每笔认购申请单独计算。认购费率如下表所示：

认购份额（M）	认购费率
M<100 万份	0.8%
100 万份≤M<300 万份	0.4%
300 万份≤M<500 万份	0.1%
M≥500 万份	1000 元/笔

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、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。基金认购费用不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。募集期间发生的信息披露费、会计师费和律师费等各项费用，不从基金财产中列支。

3. 认购费用计算公式和收取方式

（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、认购金额的计算公式为：

认购佣金=认购价格×认购份额×佣金比率

（或若适用固定费用的，认购佣金=固定费用）

认购金额=认购价格×认购份额×（1+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：某投资者通过发售代理机构采用网上现金方式认购本基金100,000份，假设该发售代理机构确认的佣金比率为0.80%，则需准备的资金数额计

算如下：

$$\text{认购佣金} = 1.00 \times 100,000 \times 0.80\% = 800 \text{ 元}$$

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 100,000 \times (1 + 0.80\%) = 100,800 \text{ 元}$$

即，若该投资人通过发售代理机构认购本基金份额100,000份，则需缴纳认购金额100,800元，其中认购佣金800元。

(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)

$$\text{净认购份额} = \text{认购份额} + \text{认购金额产生的利息} / \text{基金份额面值}$$

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。

网下现金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，具体份额以基金管理人的记录为准。利息折算的份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

例：某投资人通过基金管理人认购本基金100,000份，假定认购金额产生的利息为50元，则该投资人的认购金额为：

$$\text{认购费用} = 1.00 \times 100,000 \times 0.80\% = 800 \text{ 元}$$

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 100,000 \times (1 + 0.80\%) = 100,800 \text{ 元}$$

$$\text{总认购份额} = 100,000 + 50 / 1.00 = 100,050 \text{ 份}$$

即，若该投资人通过基金管理人认购本基金100,000份，认购费率为0.80%，假定认购金额产生的利息为50元，则该投资人的认购金额为100,800元，可得到100,050份基金份额。

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

(3) 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500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1000股，超过1000股的部分须为100股的整数倍。投资人可以多次提交认购申请，

累计申报股数不设上限。认购份额的计算公式：

$$\text{投资者的认购份额} = \sum_{i=1}^n (\text{第 } i \text{ 只股票在网下股票认购期最后一日的均价} \times \text{有效认购数量}) / 1.00$$

其中：

(1) i 代表投资人提交认购申请的第 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 $n=1$ 。

T 日为网下股票认购期最后一日。

(2) “第 i 只股票在 T 日的均价”由基金管理人根据上海证券交易所及深圳证券交易所的 T 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 T 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 T 日至登记结算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 T 日的均价进行调整：

①除息：调整后价格= T 日均价-每股现金股利或股息

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

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

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

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

⑥除息且配股：调整后价格= $(T \text{日均价} + \text{配股价} \times \text{配股比例} - \text{每股现金股利或股息}) / (1 + \text{每股配股比例})$

⑦除息、送股且配股：调整后价格= $(T \text{日均价} + \text{配股价} \times \text{配股比例} - \text{每股现金股利或股息}) / (1 + \text{每股送股比例} + \text{每股配股比例})$

(4) “有效认购数量”是指由基金管理人确认的由登记结算机构完成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中证500指数中的权重（认购期间如有中证500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500指数编制规则计算调整后的中证500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，则按比例分配确认。

② 对于未公告限制认购规模的个股，以本基金初始募集规模为准，投资者提交认购申请的数量没有超过该个股在T日中证500指数中的权重的，原则上可全部确认为有效认购数量；投资者提交认购申请的数量超过了该个股在T日中证500指数中的权重的，对于超额部分，管理人原则上不再接受流动性受限的股票。

③若某一股票在网下股票认购日至登记结算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结算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。

4. 认购限制

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。投资人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500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1000股，超过1000股的部分须为100股的整数倍。投资人可以多次提交认购申请，累计申报股数不设上限。

5. 网下股票认购的特殊情形

(1) 已公告的将被调出中证500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。

6. 募集期间认购资金与股票的处理方式

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。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结算机构清算交收后至认购资金划入托管专户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资人基金份额。

基金募集期间募集的股票由登记机构予以冻结，募集的股票自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认购投资人本人所有。

三、投资者开户

投资者认购本基金时至少需具有上海证券交易所A股账户或证券投资基金账户

1. 投资人认购本基金时需具有上海证券交易所A股账户（以下简称“上海A股账户”）或上海证券交易所证券投资基金账户（以下简称“上海证券交易所证券投资基金账户”）。

2. 账户使用注意事项

（1）如投资人需要参与网下现金或网上现金认购，应使用上海A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户；上海证券交易所证券投资基金账户只能进行本基金的现金认购和二级市场交易。

（2）如投资人以上海证券交易所上市交易的本基金成份股或备选成份股进行网下股票认购的，应开立并使用上海A股账户。

（3）如投资人以深圳证券交易所股票进行网下股票认购的，除了持有上海A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户外，还应持有深圳证券交易所A股账户（以下简称“深圳A股账户”），且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有，并注意投资人认购基金份额的托管证券公司和深圳A股账户指定交易证券公司应为同一发售代理机构。

（4）如投资人需要通过申购赎回代理券商参与本基金的申购、赎回，应同时持有并使用上海A股账户与深圳A股账户，且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有，并注意投资人用以申购、赎回的上海证券交易所股票的托管证券公司和深圳A股账户的指定交易证券公司应为同一申购赎回代理机构，否则无法办理本基金的申购和赎回。

（5）已购买过由中融基金管理有限公司担任登记机构的基金的投资人，其所持有的中融基金管理有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。

四、网上现金认购的程序

1. 业务办理时间：2019年11月6日至2019年11月8日9:30-11:30、13:00-15:00（周六、周日和节假日不受理）。

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。投资人可以多次认购，累计认购份额不设上限。

3. 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备足认购资金，办理认购手续。

五、网下现金认购的程序

1. 业务办理时间：2019年9月3日至2019年11月8日9:30-11:30、13:00-15:00（周六、周日和节假日不受理）。

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. 认购手续

（一）个人投资者通过直销柜台办理认购

（1）个人投资者未通过直销柜台办理中融基金管理有限公司开放式基金账户开户需提交下列账户材料，并投资者本人签字：

①《ETF 账户业务申请表（个人）》

②《风险承受能力调查问卷（个人）》

③《投资人权益告知书》

④《远程委托服务协议》

⑤仅为非居民或既是中国税收居民又是其他国家（地区）税收居民的投资者，须填写《CRS 个人税收居民身份声明文件》。

⑥在大陆工作、生活的港澳台居民申请认购本基金，应在大陆工作、居住满一年，并提供提供在职收入证明原件、最近 6 个月完税证明或银行代发工资最近 6 个月对账单等证明材料。

⑦个人投资者委托他人办理业务的，应提供投资者与代办人双方签署的授权委托书，并同时提供投资者本人与代办人的身份证明文件。

（2）个人投资者认购本基金时应提交下列交易材料，并投资者本人签字：

- ①《ETF 基金网下认购业务申请表（个人）》
- ②申请认购当日交易时间内需提供有效的划款凭证或划款指定。
- ③上海证券交易所 A 股账户卡，如需，也请提供深圳证券交易所 A 股账户卡复印件。
- ④个人投资者身份证明文件正反面复印件。
- ⑤个人投资者通过远程委托办理业务的，需提供申请人本人手持开户证件原件的正面照片。
- ⑥《ETF 基金风险提示书》
- ⑦个人投资者委托他人办理业务的，应提供投资者与代办人双方签署的授权委托书，并同时提供投资者本人与代办人的身份证明文件。

（二）机构投资者通过直销柜台办理认购

（1）机构投资者以自有资金、自营账户或产品账户办理基金认购，且未通过直销柜台办理中融基金管理有限公司开放式基金账户开户，应提供下列账户材料，并加盖公章或预留印鉴章：

- ①《ETF 账户业务申请表（机构）》
- ②《非自然人客户受益所有人信息登记表》及相关业务资料。
- ③《产品信息表》及产品成立、备案的证明文件（仅产品账户提供）。
- ④营业执照等身份证明材料复印件。
- ⑤《机构预留印鉴卡》，加盖公章及法人章。
- ⑥法人身份证明材料复印件。
- ⑦《机构授权委托书》
- ⑧经办人身份证明材料复印件。
- ⑨《投资人权益告知书》
- ⑩《风险承受能力调查问卷（机构）》
- ⑪《远程委托服务协议》
- ⑫营业执照未办理三证合一，或以其他类型证件办理开户的机构，还需提供组织机构代码证、税务登记证复印件。
- ⑬经有关金融监管部门批准设立的金融机构作为投资者的，还需提供开展金融相关业务资格证明。

⑭税收居民身份为消极非金融机构的投资者需填写《CRS 控制人税收居民身份声明文件》；既是中国税收居民又是其他国家（地区）税收居民或仅为非居民的投资者，需填写《CRS 机构税收居民身份声明文件》。

（2）机构投资者认购本基金时需提交下列交易材料，并加盖公章或预留印鉴章：

①《ETF 基金网下认购业务申请表（机构）》。

②需在当日交易时间内提供划款凭证或划款指令。

③上海证券交易所 A 股账户卡，如需，请一并提供深圳证券交易所 A 股账户卡复印件。

④《ETF 基金风险揭示书》。

六、网下股票认购的程序

1. 业务办理时间： 2019年9月3日至2019年11月8日9:30-11:30、13:00-15:00（周六、周日和节假日不受理）。

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中证500指数成份股和已公告的备选成份股（具体名单以发售公告为准）。单只股票最低认购申报股数为1000股，超过1000股的部分须为100股的整数倍。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

（一）个人投资者通过直销柜台办理认购

（1）个人投资者未通过直销柜台办理中融基金管理有限公司开放式基金账户开户，需提交下列账户材料，并投资者本人签字：

①《ETF 账户业务申请表（个人）》

②《风险承受能力调查问卷（个人）》

③《投资人权益告知书》

④《远程委托服务协议》

⑤仅为非居民或既是中国税收居民又是其他国家（地区）税收居民的投资者，须填写《CRS 个人税收居民身份声明文件》。

⑥在大陆工作、生活的港澳台居民申请认购本基金，应在大陆工作、居住满一年，并提供提供在职收入证明原件、最近 6 个月完税证明或银行

代发工资最近 6 个月对账单等证明材料。

⑦个人投资者委托他人办理业务的，应提供投资者与代办人双方签署的授权委托书，并同时提供投资者本人与代办人的身份证明文件。

(2) 个人投资者认购本基金时应提交下列交易材料，并投资者本人签字：

①《ETF 基金网下认购业务申请表（个人）》

②上海证券交易所 A 股账户卡，如需，也请提供深圳证券交易所 A 股账户卡复印件。

③个人投资者身份证明文件正反面复印件。

④个人投资者通过远程委托办理业务的，需提供申请人本人手持开户证件原件的正面照片。

⑤《ETF 基金风险提示书》

⑥个人投资者委托他人办理业务的，应提供投资者与代办人双方签署的授权委托书，并同时提供投资者本人与代办人的身份证明文件。

(二) 机构投资者通过直销柜台办理认购

(1) 机构投资者以自有资金、自营账户或产品账户办理基金认购，且未通过直销柜台办理中融基金管理有限公司开放式基金账户开户，应提供下列账户资料，并加盖公章或预留印鉴章：

①《ETF 账户业务申请表（机构）》

②《非自然人客户受益所有人信息登记表》及相关业务资料。

③《产品信息表》及产品成立、备案的证明文件（仅产品账户提供）。

④营业执照等身份证明材料复印件。

⑤《机构预留印鉴卡》，加盖公章及法人章。

⑥法人身份证明材料复印件。

⑦《机构授权委托书》

⑧经办人身份证明材料复印件。

⑨《投资人权益告知书》

⑩《风险承受能力调查问卷（机构）》

⑪《远程委托服务协议》

⑫营业执照未办理三证合一，或以其他类型证件办理开户的机构，还需提供组织机构代码证、税务登记证复印件。

⑬经有关金融监管部门批准设立的金融机构作为投资者的，还需提供开展金融相关业务资格证明。

⑭税收居民身份为消极非金融机构的投资者需填写《CRS 控制人税收居民身份声明文件》；既是中国税收居民又是其他国家（地区）税收居民或仅为非居民的投资者，需填写《CRS 机构税收居民身份声明文件》。

（2）机构投资者认购本基金时需提交下列交易材料，并加盖公章或预留印鉴章：

①《ETF 基金网下认购业务申请表（机构）》

②上海证券交易所 A 股账户卡，如需，请一并提供深圳证券交易所 A 股账户卡复印件

③《ETF 基金风险揭示书》。

④《关于参与中融中证 500 交易型开放式指数证券投资基金网下股票认购的承诺函》原件。

4. 特别提示：投资人应根据法律法规及深圳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。

七、清算与交割

1. 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。基金募集期间募集的股票由登记机构予以冻结，募集的股票自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认购投资人本人所有。募集期间发生的信息披露费、会计师费和律师费等各项费用，不从基金财产中列支。

2. 网下现金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，具体份额以基金管理人的记录为准。利息折算的份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产；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结算机构清算交收

后至认购资金划入托管专户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资人基金份额；基金募集期间募集的股票由登记机构予以冻结，募集的股票自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认购投资人本人所有。

3. T日通过基金管理人提交的网下现金认购申请，于T+2日内进行有效认购款项的清算交收，将资金划入基管理人预先开设基金募集专户。现金认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归持有人所有，认购款项利息数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结算机构清算交收后至认购资金划入托管专户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资人基金份额。

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。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，登记结算机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发行协调人，发行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。

4. 网下股票认购期内每日日终，发售代理机构将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，登记结算机构根据基金管理人提供的确认数据，冻结上海市场网下认购股票，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。基金管理人为投资者计算认购份额，并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，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。登记结算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，并根据基金管理人确认的认购申请股票数据，按照交易所和登记结算机构的规则和流程，最终将投资者申请认购的股票过户到本基金在上海、深圳开立的证券账户。

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。

5. 本基金权益登记由登记结算机构在基金募集结束后完成过户登记。

八、基金资产的验资与基金合同生效

基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）、基金认购人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人为本基金开立的基金托管专户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

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由发售代理机构予以冻结，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

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。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，发售代理机构应予以解冻。

九、有关当事人或中介机构

（一）基金管理人

名称：中融基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3202、3203B

办公地址：北京市朝阳区东风南路3号院中融信托北京园区C座4层、5层

法定代表人：王瑶

电话：010-56517000

传真：010-56517001

联系人：肖佳琦

客服电话：400-160-6000、010-56517299

网址：www.zrfunds.com.cn

（二）基金托管人

名称：中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

法定代表人：李晓鹏

成立日期：1992年6月18日

批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7号

组织形式：股份有限公司

注册资本：466.79095亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监基金字[2002]75号

投资与托管部总经理：张博

电话：010-63636363

传真：010-63639132

网址：www.cebbank.com

（三）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

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：崔巍

电话：010-59378856

传真：010-59378907

（四）销售机构

1. 发行协调人

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：010-83574507

联系人：辛国政

客服电话：4008-888-888或95551

2. 基金份额销售机构

（1）网下现金发售直销机构和网下股票发售直销机构

名称：中融基金管理有限公司直销中心

住所：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3202、3203B

办公地址：北京市朝阳区东风南路3号院中融信托北京园区C座4层

法定代表人：王瑶

邮政编码：100016

电话：010-56517002、010-56517003

传真：010-64345889、010-84568832

联系人：赵琦、巩京博

邮箱：zhixiao@zrfunds.com.cn

网址：www.zrfunds.com.cn

（2）网上现金发售代理机构

本基金的网上现金发售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。

（3）网下现金发售代理机构

1) 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单元

法定代表人：王连志

电话：0755-82558305

联系人：陈剑虹

客服电话：95517

2) 渤海证券股份有限公司

住所：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：王春峰

电话：022-28451991

联系人：蔡霆

客服电话：400-651-5988

3) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：周健男

客服电话：95525

4) 广发证券股份有限公司

住所：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址：广州市天河区马场路26号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

客服电话：95575

5) 国泰君安证券股份有限公司

住所：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

联系人：芮敏祺

客服电话：95521/400-8888-666

6) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦6楼

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

联系人：李颖

客服电话：95536

7) 华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人：章宏韬

客服电话：95318

8) 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：李琦

客服电话：4008-000-562

9) 申万宏源证券有限公司

住所：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

客服电话：021-33389888

10) 长江证券股份有限公司

住所：湖北省武汉市新华路特8号

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：李新华

电话：027-65799999

联系人：奚博宇

客服电话：95579

11) 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：010-83574507

联系人：辛国政

客服电话：4008-888-888或95551

12) 中国中金财富证券有限公司

住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：高涛

客服电话：95532、400-600-8008

13) 中泰证券股份有限公司

住所：济南市市中区经七路86号

办公地址：上海市花园石桥路66号东亚银行金融大厦18层

法定代表人：李玮

电话：021-20315290

联系人：许曼华

客服电话：95538

14) 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

客服电话：95587/4008-888-108

15) 中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

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：姜晓林

电话：0532-85022326

联系人：吴忠超

客服电话：95548

16) 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：张佑君

电话：010-60838888

联系人：顾凌

客服电话：95548

（4）网下股票发售代理机构

1) 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼、28层A02单元

法定代表人：王连志

电话：0755-82558305

联系人：陈剑虹

客服电话：95517

2) 渤海证券股份有限公司

住所：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：王春峰

电话：022-28451991

联系人：蔡霆

客服电话：400-651-5988

3) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：周健男

客服电话：95525

4) 广发证券股份有限公司

住所：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址：广州市天河区马场路26号广发证券大厦

法定代表人：孙树明

客服电话：95575

5) 国泰君安证券股份有限公司

住所：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

联系人：芮敏祺

客服电话：95521/400-8888-666

6) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦6楼

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

联系人：李颖

客服电话：95536

7) 华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人：章宏韬

客服电话：95318

8) 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：李琦

客服电话：4008-000-562

9) 申万宏源证券有限公司

住所：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

客服电话：021-33389888

10) 长江证券股份有限公司

住所：湖北省武汉市新华路特8号

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：李新华

电话：027-65799999

联系人：奚博宇

客服电话：95579

11) 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：010-83574507

联系人：辛国政

客服电话：4008-888-888或95551

12) 中国中金财富证券有限公司

住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：高涛

客服电话：95532、400-600-8008

13) 中泰证券股份有限公司

住所：济南市市中区经七路86号

办公地址：上海市花园石桥路66号东亚银行金融大厦18层

法定代表人：李玮

电话：021-20315290

联系人：许曼华

客服电话：95538

14) 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

客服电话：95587/4008-888-108

（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：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

经办律师：安冬、陆奇

（六）审计基金资产的会计师事务所

名称：上会会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼

办公地址：上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼

执行事务合伙人：张晓荣（首席合伙人）

电话：021-52920000

传真：021-52921369

经办注册会计师：陈大愚、江嘉炜

联系人：杨伟平

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500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。如遇中证500指数成份股调整，则最终确认可接受股票换购的清单以最终调整公告的成份股清单为准。

中融中证500交易型开放式指数证券投资基金网下股票认购名单

股票代码	股票简称	股票代码	股票简称	股票代码	股票简称	股票代码	股票简称
000006.SZ	深振业 A	000062.SZ	深圳华强	000766.SZ	通化金马	600729.SH	重庆百货
000031.SZ	大悦城	002038.SZ	双鹭药业	600282.SH	南钢股份	600639.SH	浦东金桥
000028.SZ	国药一致	002491.SZ	通鼎互联	600575.SH	皖江物流	600839.SH	四川长虹
002434.SZ	万里扬	002223.SZ	鱼跃医疗	600827.SH	百联股份	300297.SZ	蓝盾股份
000959.SZ	首钢股份	002002.SZ	鸿达兴业	600707.SH	彩虹股份	600845.SH	宝信软件
002507.SZ	涪陵榨菜	300115.SZ	长盈精密	600739.SH	辽宁成大	600657.SH	信达地产
002603.SZ	以岭药业	300088.SZ	长信科技	600376.SH	首开股份	002807.SZ	江阴银行
002280.SZ	联络互动	002183.SZ	怡亚通	603766.SH	隆鑫通用	600673.SH	东阳光
000089.SZ	深圳机场	000926.SZ	福星股份	600325.SH	华发股份	600643.SH	爱建集团
601333.SH	广深铁路	600008.SH	首创股份	603885.SH	吉祥航空	601880.SH	大连港
000401.SZ	冀东水泥	002408.SZ	齐翔腾达	600277.SH	亿利洁能	600996.SH	贵广网络
601608.SH	中信重工	002212.SZ	南洋股份	601966.SH	玲珑轮胎	603806.SH	福斯特
000559.SZ	万向钱潮	002317.SZ	众生药业	601005.SH	重庆钢铁	600754.SH	锦江股份
000598.SZ	兴蓉环境	002004.SZ	华邦健康	600971.SH	恒源煤电	603228.SH	景旺电子
000078.SZ	海王生物	002399.SZ	海普瑞	002332.SZ	仙琚制药	000887.SZ	中鼎股份
000090.SZ	天健集团	002416.SZ	爱施德	601127.SH	小康股份	600808.SH	马钢股份
600348.SH	阳泉煤业	002157.SZ	正邦科技	603077.SH	和邦生物	600765.SH	中航重机
002366.SZ	台海核电	000975.SZ	银泰资源	600478.SH	科力远	002129.SZ	中环股份
000488.SZ	晨鸣纸业	002127.SZ	南极电商	601003.SH	柳钢股份	002437.SZ	誉衡药业
002517.SZ	恺英网络	002195.SZ	二三四五	000039.SZ	中集集团	002690.SZ	美亚光电
000513.SZ	丽珠集团	601869.SH	长飞光纤	600820.SH	隧道股份	002512.SZ	达华智能
600597.SH	光明乳业	002030.SZ	达安基因	603816.SH	顾家家居	002640.SZ	跨境通
600782.SH	新钢股份	000988.SZ	华工科技	603000.SH	人民网	300324.SZ	旋极信息
000990.SZ	诚志股份	002371.SZ	北方华创	600633.SH	浙数文化	600823.SH	世茂股份
300199.SZ	翰宇药业	300027.SZ	华谊兄弟	600418.SH	江淮汽车	002375.SZ	亚厦股份
000552.SZ	靖远煤电	000997.SZ	新大陆	600901.SH	江苏租赁	603369.SH	今世缘
002078.SZ	太阳纸业	002920.SZ	德赛西威	603501.SH	韦尔股份	600759.SH	洲际油气
000426.SZ	兴业矿业	603517.SH	绝味食品	000537.SZ	广宇发展	603025.SH	大豪科技
300133.SZ	华策影视	002572.SZ	索菲亚	600335.SH	国机汽车	603650.SH	彤程新材
000501.SZ	鄂武商 A	002387.SZ	维信诺	600392.SH	盛和资源	600717.SH	天津港
002268.SZ	卫士通	002051.SZ	中工国际	600567.SH	山鹰纸业	600757.SH	长江传媒
000547.SZ	航天发展	601958.SH	金钼股份	600694.SH	大商股份	600098.SH	广州发展
000987.SZ	越秀金控	300459.SZ	金科文化	600801.SH	华新水泥	000158.SZ	常山北明
000543.SZ	皖能电力	601139.SH	深圳燃气	600664.SH	哈药股份	002431.SZ	棕榈股份
002444.SZ	巨星科技	002074.SZ	国轩高科	600515.SH	海航基础	600939.SH	重庆建工
000930.SZ	中粮生化	002424.SZ	贵州百灵	600022.SH	山东钢铁	000400.SZ	许继电气
002093.SZ	国脉科技	002699.SZ	美盛文化	600779.SH	水井坊	600770.SH	综艺股份
300009.SZ	安科生物	300207.SZ	欣旺达	603877.SH	太平鸟	601311.SH	骆驼股份
000581.SZ	威孚高科	300001.SZ	特锐德	600380.SH	健康元	600863.SH	内蒙华电
000541.SZ	佛山照明	002155.SZ	湖南黄金	600460.SH	士兰微	600748.SH	上实发展

601106.SH	中国一重	002174.SZ	游族网络	600486.SH	扬农化工	603486.SH	科沃斯
600039.SH	四川路桥	002419.SZ	天虹股份	600259.SH	广晟有色	600737.SH	中粮糖业
000587.SZ	金洲慈航	601866.SH	中远海发	600410.SH	华胜天成	600745.SH	闻泰科技
300244.SZ	迪安诊断	300182.SZ	捷成股份	600169.SH	太原重工	600755.SH	厦门国贸
000686.SZ	东北证券	002064.SZ	华峰氨纶	002745.SZ	木林森	600750.SH	江中药业
600291.SH	西水股份	601718.SH	际华集团	300316.SZ	晶盛机电	000758.SZ	中色股份
300055.SZ	万邦达	002075.SZ	沙钢股份	600388.SH	龙净环保	000623.SZ	吉林敖东
000681.SZ	视觉中国	600126.SH	杭钢股份	600528.SH	中铁工业	000778.SZ	新兴铸管
000563.SZ	陕国投 A	600316.SH	洪都航空	002131.SZ	利欧股份	600777.SH	新潮能源
002273.SZ	水晶光电	600155.SH	华创阳安	000983.SZ	西山煤电	600315.SH	上海家化
000718.SZ	苏宁环球	002048.SZ	宁波华翔	603056.SH	德邦股份	601811.SH	新华文轩
000750.SZ	国海证券	002583.SZ	海能达	600409.SH	三友化工	601969.SH	海南矿业
000869.SZ	张裕 A	300168.SZ	万达信息	600435.SH	北方导航	600787.SH	中储股份
300058.SZ	蓝色光标	002250.SZ	联化科技	600266.SH	北京城建	603377.SH	东方时尚
603939.SH	益丰药房	002056.SZ	横店东磁	600426.SH	华鲁恒升	600908.SH	无锡银行
000826.SZ	启迪环境	600158.SH	中体产业	600053.SH	九鼎投资	600970.SH	中材国际
000883.SZ	湖北能源	600280.SH	中央商场	002607.SZ	中公教育	601016.SH	节能风电
000738.SZ	航发控制	600062.SH	华润双鹤	600645.SH	中源协和	600885.SH	宏发股份
002707.SZ	众信旅游	600056.SH	中国医药	600416.SH	湘电股份	000021.SZ	深科技
600307.SH	酒钢宏兴	002368.SZ	太极股份	600507.SH	方大特钢	600862.SH	中航高科
000636.SZ	风华高科	600167.SH	联美控股	600466.SH	蓝光发展	601777.SH	力帆股份
002176.SZ	江特电机	600143.SH	金发科技	600428.SH	中远海特	000600.SZ	建投能源
000717.SZ	韶钢松山	600201.SH	生物股份	002152.SZ	广电运通	600017.SH	日照港
300308.SZ	中际旭创	600079.SH	人福医药	600166.SH	福田汽车	000528.SZ	柳工
603712.SH	七一二	002049.SZ	紫光国微	603515.SH	欧普照明	002573.SZ	清新环境
000829.SZ	天音控股	601100.SH	恒立液压	000012.SZ	南玻 A	002266.SZ	浙富控股
000723.SZ	美锦能源	600125.SH	铁龙物流	600458.SH	时代新材	601098.SH	中南传媒
002233.SZ	塔牌集团	002831.SZ	裕同科技	002028.SZ	思源电气	600859.SH	王府井
300253.SZ	卫宁健康	600258.SH	首旅酒店	600536.SH	中国软件	601928.SH	凤凰传媒
600094.SH	大名城	601699.SH	潞安环能	600500.SH	中化国际	000519.SZ	中兵红箭
002385.SZ	大北农	002244.SZ	滨江集团	603569.SH	长久物流	600917.SH	重庆燃气
002426.SZ	胜利精密	600006.SH	东风汽车	603198.SH	迎驾贡酒	600875.SH	东方电气
600058.SH	五矿发展	601118.SH	海南橡胶	600903.SH	贵州燃气	002221.SZ	东华能源
600179.SH	ST 安通	002941.SZ	新疆交建	000536.SZ	华映科技	600869.SH	智慧能源
000685.SZ	中山公用	002482.SZ	广田集团	002092.SZ	中泰化学	002353.SZ	杰瑞股份
000727.SZ	华东科技	600120.SH	浙江东方	600350.SH	山东高速	601689.SH	拓普集团
300159.SZ	新研股份	000009.SZ	中国宝安	000712.SZ	锦龙股份	002191.SZ	劲嘉股份
600521.SH	华海药业	000156.SZ	华数传媒	300010.SZ	立思辰	600642.SH	申能股份
600037.SH	歌华有线	002372.SZ	伟星新材	000732.SZ	泰禾集团	600884.SH	杉杉股份
002509.SZ	天广中茂	600260.SH	凯乐科技	600565.SH	迪马股份	603659.SH	璞泰来
300002.SZ	神州泰岳	600549.SH	厦门钨业	600648.SH	外高桥	601717.SH	郑煤机
000998.SZ	隆平高科	600161.SH	天坛生物	600499.SH	科达洁能	600959.SH	江苏有线
300113.SZ	顺网科技	600026.SH	中远海能	002217.SZ	合力泰	601326.SH	秦港股份

600064.SH	南京高科	600151.SH	航天机电	601200.SH	上海环境	600881.SH	亚泰集团
300166.SZ	东方国信	600141.SH	兴发集团	002503.SZ	搜于特	002251.SZ	步步高
000980.SZ	众泰汽车	600216.SH	浙江医药	600909.SH	华安证券	600872.SH	中炬高新
300257.SZ	开山股份	002373.SZ	千方科技	600848.SH	上海临港	600879.SH	航天电子
300383.SZ	光环新网	600138.SH	中青旅	600874.SH	创业环保	600967.SH	内蒙一机
000807.SZ	云铝股份	601128.SH	常熟银行	002019.SZ	亿帆医药	601678.SH	滨化股份
002085.SZ	万丰奥威	002382.SZ	蓝帆医疗	600525.SH	长园集团	603225.SH	新凤鸣
300134.SZ	大富科技	002589.SZ	瑞康医药	600718.SH	东软集团	603568.SH	伟明环保
300376.SZ	易事特	600171.SH	上海贝岭	601179.SH	中国西电	002344.SZ	海宁皮城
601615.SH	明阳智能	000060.SZ	中金岭南	600582.SH	天地科技	601068.SH	中铝国际
002463.SZ	沪电股份	600393.SH	粤泰股份	600699.SH	均胜电子	603328.SH	依顿电子
000960.SZ	锡业股份	600195.SH	中牧股份	002701.SZ	奥瑞金	601231.SH	环旭电子
000813.SZ	德展健康	600060.SH	海信电器	600804.SH	鹏博士	002544.SZ	杰赛科技
600267.SH	海正药业	002242.SZ	九阳股份	000999.SZ	华润三九	002812.SZ	恩捷股份
300266.SZ	兴源环境	600183.SH	生益科技	300450.SZ	先导智能	600993.SH	马应龙
002948.SZ	青岛银行	601872.SH	招商轮船	000025.SZ	特力 A	603233.SH	大参林
600021.SH	上海电力	600298.SH	安琪酵母	000690.SZ	宝新能源	002254.SZ	泰和新材
002281.SZ	光迅科技	600373.SH	中文传媒	600545.SH	卓郎智能	603355.SH	莱克电气
000848.SZ	承德露露	600511.SH	国药股份	002681.SZ	奋达科技	002470.SZ	金正大
000878.SZ	云南铜业	000932.SZ	华菱钢铁	600598.SH	北大荒	601019.SH	山东出版
002299.SZ	圣农发展	601611.SH	中国核建	600751.SH	海航科技	002797.SZ	第一创业
002285.SZ	世联行	600640.SH	号百控股	600557.SH	康缘药业	000027.SZ	深圳能源
000970.SZ	中科三环	600312.SH	平高电气	300197.SZ	铁汉生态	601168.SH	西部矿业
002390.SZ	信邦制药	601801.SH	皖新传媒	600563.SH	法拉电子	000564.SZ	供销大集
300418.SZ	昆仑万维	002635.SZ	安洁科技	600572.SH	康恩贝	000066.SZ	中国长城
002936.SZ	郑州银行	603866.SH	桃李面包	000061.SZ	农产品	601000.SH	唐山港
002414.SZ	高德红外	002665.SZ	首航节能	000937.SZ	冀中能源	002709.SZ	天赐材料
300026.SZ	红日药业	600978.SH	宜华生活	600985.SH	淮北矿业	002670.SZ	国盛金控
002506.SZ	协鑫集成	000301.SZ	东方盛虹	600580.SH	卧龙电驱	002384.SZ	东山精密
002465.SZ	海格通信	002128.SZ	露天煤业	600649.SH	城投控股	002500.SZ	山西证券
000830.SZ	鲁西化工	600338.SH	西藏珠峰	600584.SH	长电科技	002489.SZ	浙江永强
002302.SZ	西部建设	000008.SZ	神州高铁	600623.SH	华谊集团	002815.SZ	崇达技术
002405.SZ	四维图新	002946.SZ	新乳业	603444.SH	吉比特	002118.SZ	紫鑫药业
002916.SZ	深南电路	600329.SH	中新药业	600895.SH	张江高科	002407.SZ	多氟多
002505.SZ	大康农业	603888.SH	新华网	600835.SH	上海机电	002249.SZ	大洋电机
000877.SZ	天山股份	600497.SH	驰宏锌锗	600811.SH	东方集团	600073.SH	上海梅林
300315.SZ	掌趣科技	002818.SZ	富森美	600763.SH	通策医疗	600160.SH	巨化股份
000860.SZ	顺鑫农业	600317.SH	营口港	000761.SZ	本钢板材	002340.SZ	格林美
002110.SZ	三钢闽光	601001.SH	大同煤业	002440.SZ	闰土股份	002439.SZ	启明星辰
300274.SZ	阳光电源	002839.SZ	张家港行	600611.SH	大众交通	002821.SZ	凯莱英
002358.SZ	森源电气	603556.SH	海兴电力	000729.SZ	燕京啤酒	002926.SZ	华西证券
300287.SZ	飞利信	603868.SH	飞科电器	603883.SH	老百姓	002672.SZ	东江环保

中融基金管理有限公司

2019年8月30日