

融通巨潮 100 指数证券投资基金（LOF）
更新招募说明书摘要
(2012 年第 1 号)

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

日 期：二〇一二年六月

融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书摘要
(2012 年第 1 号)

融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 经中国证监会证监基金字【2005】18 号文核准公开发售。核准日期为 2005 年 2 月 6 日。本基金为上市契约型开放式基金, 基金合同生效日 2005 年 5 月 12 日。

重要提示

投资有风险, 投资者申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写, 并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额, 即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人, 其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受, 并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务, 应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为 2012 年 5 月 12 日, 有关财务数据截止日为 2012 年 3 月 31 日, 本招募说明书中的财务数据未经审计。

一、基金合同生效日

2005 年 5 月 12 日

二、基金管理人

(一) 基金管理人概况

名称: 融通基金管理有限公司

注册地址: 深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

办公地址: 深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

设立日期: 2001 年 5 月 22 日

法定代表人: 田德军

电话: (0755) 26948070

联系人: 敖敬东

注册资本: 12500 万元人民币

目前公司股东及出资比例为：新时代证券有限责任公司 60%、日兴资产管理有限公司 (Nikko Asset Management Co., Ltd.) 40%。

(二) 主要人员情况

1、现任董事情况

董事长田德军先生，经济学博士，现任新时代证券有限责任公司总经理。历任中信证券股份有限公司投资银行业务主管，上海远东证券有限公司董事长兼总经理。2010 年至今任公司董事长。

独立董事杜婕女士，中国注册会计师，现任吉林大学经济学院教授。历任电力部第一工程局一处主管会计，吉林大学讲师、副教授、教授。2011 年至今任公司独立董事。

独立董事田利辉先生，伦敦商学院金融学博士，密歇根大学经济学博士后，具有中国律师执业资格，现任南开大学教授、南开大学金融发展研究院副院长，兼职任教于北京大学光华管理学院。2011 年至今任公司独立董事。

独立董事施天涛先生，教授，现任清华大学法学院副院长、学术委员会副主任、资本金融与法律研究中心主任。曾任新加坡东亚政治经济研究所访问研究员，美国斯坦福大学法学院访问教授，北京市第十届政协常委。2012 年起任公司独立董事。

董事马金声先生，高级经济师，现任新时代证券有限责任公司董事长。历任中国人民银行办公厅副主任、主任，金银管理司司长；中国农业发展银行副行长；国泰君安证券股份有限公司党委书记兼副董事长；华林证券有限责任公司党委书记。2007 年至今任公司董事。

董事奚星华先生，经济学硕士，现任公司总经理。历任黑龙江省证券公司宏观行业研究员，北京时代博讯高科技有限公司投资业务副总经理，长财证券经纪有限责任公司总裁，恒泰长财证券有限责任公司执行董事、法定代表人。2012 年起任公司董事。

董事弗莱德 (Frederick Reidenbach) 先生，毕业于美国宾夕法尼亚州斯克兰顿大学并且拥有会计师执照，现任日兴资产管理有限公司首席财务官和首席营运官。历任日本富达投资首席行政官、富达投资 (Fidelity Investment) 旗下子公司 KVH 电信的首席执行长和首席营运官，日本 Aon Risk Services 的首席财务官和首席营运官。2010 年至今任公司董事。

董事裴布雷 (Blair Pickerell) 先生，斯坦福大学硕士及哈佛商学院 MBA，现任日兴资产管理有限公司亚洲区总裁兼全球首席营销官。历任摩根士丹利投资管理部亚洲区主管、汇丰投资管理 (香港) 有限公司亚太区行政总裁及怡富集团董事长。2012 年起任公司董事。

董事涂卫东先生, 法学硕士, 现任公司督察长。历任国务院法制办公室 (原国务院法制局) 财金司公务员, 曾在中国证监会法律部和基金监管部工作, 曾是中国证监会公职律师。2010 年至今任公司董事。

2、现任监事情况

监事李华先生, 经济学硕士, 现任公司监察稽核部总监。曾任北京大学经济管理系讲师, 1993 年起历任广东省南方金融服务总公司基金部副总经理、广东华侨信托投资公司规划发展部总经理、广州鼎源投资理财顾问有限公司总经理兼广东南方资信评估公司董事长、天一证券有限责任公司广州营业部总经理及华南业务总部总经理。2011 年至今任公司监事。

3、公司高级管理人员情况

总经理奚星华先生, 经济学硕士。历任黑龙江省证券公司宏观行业研究员, 北京时代博讯高科技有限公司投资业务副总经理, 长财证券经纪有限责任公司总裁, 恒泰长财证券有限责任公司执行董事、法定代表人。2011 年至今任公司总经理。

常务副总经理颜锡廉 (Allen Yan) 先生, 工商管理硕士。历任美国富达投资公司财务分析员、日本富达投资公司财务经理, 日兴资产管理有限公司财务企划与分析部部长。2011 年至今任公司常务副总经理。

副总经理秦玮先生, 工学硕士。历任中国工商银行深圳分行格兰信息咨询公司总经理助理, 鹏华基金管理有限公司行政部总监, 融通基金管理有限公司登记清算部总监、总经理助理等职务。2009 年至今任公司副总经理。

督察长涂卫东先生, 法学硕士。历任国务院法制办公室 (原国务院法制局) 财金司公务员, 曾在中国证监会法律部和基金监管部工作, 曾是中国证监会公职律师。2011 年至今任公司督察长。

4、本基金基金经理

(1) 现任基金经理情况

王建强先生, 本科学历, 8 年证券从业经验。2001 年至 2004 年就职于上海市万得信息技术股份有限公司; 2004 年至今就职于融通基金管理有限公司, 历任金融工程研究员、基金经理助理职务。现同时担任融通深证 100 指数基金、融通深证成份指数基金、融通创业板指数基金的基金经理。

(2) 历任基金经理情况

自 2005 年 5 月 12 日至 2009 年 5 月 14 日期间, 由张野先生担任本基金基金经理。

自 2009 年 5 月 15 日至 2010 年 4 月 16 日期间, 由郑毅先生和王建强先生共同担任本基金基金经理。

自 2010 年 4 月 17 日起至今, 由王建强先生担任基金经理。

5、投资决策委员会成员

公司投资决策委员会由总经理助理陈晓生先生、基金管理部总监、基金经理吴巍先生、研究策划部总监邹曦先生、基金交易部总监王冰心先生、基金经理郭恒先生组成。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金托管人

(一) 基金托管人情况

1、基本情况

名称: 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: 姜建清

注册资本: 人民币 349,018,545,827 元

联系电话: 010-66105799

联系人: 赵会军

2、主要人员情况

截至 2012 年 3 月末, 中国工商银行资产托管部共有员工 145 人, 平均年龄 30 岁, 95%以上员工拥有大学本科以上学历, 高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者, 中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来, 秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨, 依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队, 严格履行资产托管人职责, 为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务, 展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资

产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2012 年 3 月，中国工商银行共托管证券投资基金 239 只，其中封闭式 7 只，开放式 232 只。自 2003 年以来，本行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财经》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 29 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（二）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继 2005、2007、2009、2010 年四次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70（审计标准第 70 号）审阅后，2011 年中国工商银行资产托管部第五次通过 ISAE3402（原 SAS70）审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。

各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1) 合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求,并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2) 完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约;监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节,覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录;按照“内控优先”的原则,新设机构或新增业务品种时,必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险,审慎经营,保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善,并保证得到全面落实执行,不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门;直接操作人员和控制人员必须相对独立,适当分离;托管部内部设置独立的负责内部风险的部门,专责内控制度的检查。

4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离,建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度,并采取了良好的防火墙隔离制度,能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者,要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况,以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展,并根据检查情况提出内部控制措施,督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制,建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线,健全绩效考核和激励机制,树立“以人为本”的内控文化,增强员工的责任心和荣誉感,培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书,使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务,从而有效地控制和配置组织资源,达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理,

定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控, 指导业务部门进行风险识别、评估, 制定并实施风险控制措施, 排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心, 制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案, 并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战, 资产托管部不断提高演练标准, 从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看, 资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门, 配备专职稽核监察人员, 在总经理的直接领导下, 依照有关法律规章, 全面贯彻落实全程监控思想, 确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构, 实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与, 只有这样, 风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理, 将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位, 每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责, 通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构, 形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设, 一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力, 资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度, 包括: 岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等, 覆盖所有部门和岗位, 渗透各项业务过程, 形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一, 保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务, 资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作, 一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展, 新问题、新情况不断出现, 资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置, 视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关基金法律法规的规定, 对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人

报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关基金法律法规规定的行为,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及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。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。

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

四、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构

(1) 融通基金管理有限公司深圳投资理财中心

办公地址: 深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

邮政编码: 518053

联系人: 徐诗

电话: (0755) 26947583

传真: (0755) 26935139

客户服务中心电话: 400-883-8088 (免长途通话费用)、(0755) 26948088

(2) 融通基金管理有限公司北京分公司

地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 1241-1243 室

邮编: 100140

联系人: 宋雅萍

电话: (010) 66190975

传真: (010) 88091635

(3) 融通基金管理有限公司上海分公司

地址: 上海市世纪大道 8 号国金中心汇丰银行大楼 6 楼 601-602

邮编: 200120

联系人: 刘佳佳

电话: (021) 38424889

传真: (021) 38424884

2、场内代销机构:

所有符合中国证券登记结算有限责任公司参与人资格的场内券商均可代销场内业务。

3、场外代销机构:

(1) 中国工商银行

住所: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人: 姜建清

联系人: 田耕

电话: (010) 66107900

传真: (010) 66107914

客户服务电话: 95588

(2) 交通银行

注册地址: 上海市仙霞路 18 号

办公地址: 上海市银城中路 188 号

法定代表人: 胡怀邦

联系人: 王玮

电话: (021) 58781234

传真: (021) 58408842

客户服务电话: 95559

(3) 深圳发展银行

注册地址: 深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人: 肖遂宁

联系人: 周勤

电话: (0755) 82088888 转 8811

传真: (0755) 82080714

客户服务电话: 95501

(4) 招商银行

注册地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人: 秦晓

联系人: 朱虹、刘薇

电话: (0755) 83195834、(0755) 83195771

传真: (0755) 83195049

客户服务电话: 95555

(5) 国泰君安

注册地址: 上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址: 上海市延平路 135 号

法定代表人: 祝幼一

联系人: 芮敏祺

电话: (021) 62580818 转 213

传真: (021) 62569400

客服热线: 400-8888-666

(6) 银河证券

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: 顾伟国

联系人: 郭京华

电话: (010) 66568613、(010) 66568587

传真: (010) 66568536

客户服务热线: 400-888-888

(7) 海通证券

注册地址: 上海淮海中路 98 号

法定代表人: 王开国

联系人: 金芸、杨薇

电话: (021) 53594566

服务热线: 400-8888-001、(021) 962503 或拨打各城市营业网点咨询电话

(8) 广发证券

住所: 广东省珠海市吉大海滨路光大贸易中心 26 楼 2611 室

办公地址: 广州市天河区天河北路 183 号大都会广场 36、38、41 和 42 楼

法定代表人: 王志伟

联系人: 肖中梅

电话: (020) 87555888 转 875

传真: (020) 87557985

客户服务热线: (020) 87555888 或拨打各城市营业网点咨询电话

(9) 国信证券

住所: 深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人: 何如

联系人: 林建闽

电话: (0755) 82130833 转 2181

传真: (0755) 82133302

客户服务电话: 800-810-8868

(10) 中信建投证券

注册地址: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址: 北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人: 张佑君

联系人: 权唐

电话: (010) 65186758

传真: (010) 65182261

客户服务电话: 400-8888-108 (免长途费)

(11) 东方证券

注册地址: 上海浦东大道 720 号 20 楼

法定代表人: 王益民

联系人: 盛云

电话: (021) 50367888

传真: (021) 50366868

客服热线: (021) 95503

(12) 国元证券

住所: 安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人: 凤良志

客户服务电话: 4008-888-777

联系人: 李蔡

(13) 民生证券

办公地址：北京市朝阳区门外大街 16 号中国人寿大厦 1901 室

法定代表人：岳献春

联系人：杨魁华

电话：(010) 85252564

传真：(010) 85252655

客服热线：(0371) 7639999

(14) 华泰证券

注册地址：南京中山东路 90 号

法定代表人：吴万善

联系人：袁红彬

电话：(025) 84457777 转 721

传真：(025) 84579879

客户服务电话：4008-888-168 或 (025) 84579897

(15) 兴业证券

住所：福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人：兰荣

联系人：缪白

电话：(021) 68419125

客户服务热线：(021) 68419125

(16) 平安证券

注册地址：深圳福田区八卦岭三路平安大厦 3 楼

法定代表人：杨秀丽

联系人：余江

电话：(0755) 82440136、(0755) 82450826

传真：(0755) 82433794

服务热线：95511、(0755) 82440136

(17) 长江证券

注册地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话: (027) 65799999

传真: (027) 85481900

联系人: 李良

客服热线: 4008-888-999、95579

(18) 东吴证券

注册地址: 江苏省苏州市十梓街 298 号

办公地址: 江苏省苏州市十梓街 298 号

法定代表人: 吴永敏

联系人: 方晓丹

电话: (0512) 65581136

传真: (0512) 65588021

客服热线: (0512) 96288

(19) 长城证券

注册地址: 深圳福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 楼

法定代表人: 魏云鹏

联系人: 高峰

电话: (0755) 83516094

传真: (0755) 83516199

服务热线: (0755) 82288968

(20) 华安证券

住所: 安徽省合肥市阜南路 166 号

法定代表人: 汪永平

联系人: 唐泳

电话: (0551) 5161671

传真: (0551) 5161672

(21) 华西证券

注册地址: 四川省成都市陕西街 239 号

办公地址: 深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼 (深圳总部)

法定代表人: 张慎修

联系人: 杨玲

电话: (0755) 83025430

传真: (0755) 83025991

客户服务电话: 4008-888-818

(22) 申银万国

注册地址: 上海市常熟路 171 号

法定代表人: 丁国荣

联系人: 胡洁静

电话: (021) 54033888 转 2612

传真: (021) 54038844

客服热线: (021) 962505

(23) 金元证券

注册地址: 海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼

办公地址: 深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人: 陆涛

电话: (0755) 83025022

传真: (0755) 83025625

联系人: 张萍

客服热线: 4008-888-228

(24) 南京证券

注册地址: 江苏省南京市大钟亭 8 号

法人代表: 张华东

联系人: 胥春阳

电话: (025) 83364032

传真: (025) 83364032

(25) 国盛证券

注册地址: 江西省南昌市永叔路 15 号 (330003)

办公地址: 江西省南昌市永叔路 15 号信达大厦 10-13 楼

法定代表人: 管荣升

联系人: 万齐志

电话: (0791) 6289771

传真: (0791) 6289395

(26) 光大证券

住所: 上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 15-16 楼

法定代表人: 王明权

联系人: 张琦

电话: (021) 68816000

传真: (021) 68817271

客户服务电话: 021-68816770

(27) 国联证券

注册地址: 无锡市县前东街 8 号

法定代表人: 范炎

联系人: 袁丽萍

电话: (0510) 2831662

传真: (0510) 2831589

客服热线: (0510) 2588168

(28) 新时代证券

注册地址: 北京市西城区月坛北街 2 号月坛大厦 1501 室

法定代表人: 马金声

联系人: 戴荻

电话: (010) 68084591

传真: (010) 68084986

客户服务热线: 400-6989-898

(29) 世纪证券

注册地址: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 41 层

办公地址: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 41 层

法定代表人: 段强

联系人: 邓耀

电话: (0755) 83199599

客户服务电话: (0755) 83199527

(30) 招商证券

注册地址: 深圳福田区益田路江苏大厦 38--45 层

办公地址: 深圳福田区益田路江苏大厦 38--45 层

法定代表人: 宫少林

联系人: 黄健

电话: (0755) 82943511

传真: (0755) 82943237

客户服务电话: 4008888111、(0755) 26951111

(31) 东北证券

注册地址: 长春市人民大街 138-1 号

法定代表人: 李树

联系人: 高新宇

电话: (0431) 5096710

传真: (0431) 5680032

客户服务电话: (0431) 96688-99

(32) 第一创业

注册地址: 深圳罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25 层

法定代表人: 刘学民

联系人: 刘红星

电话: (0755) 25832455

传真: (0755) 25831718

(33) 国海证券

办公地址: 广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人: 张雅峰

联系人: 张建勋

电话: (0755) 82485852

传真: (0755) 82485852

客户服务电话: (0771) 96100

(34) 东莞证券

办公地址: 东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人: 周建辉

联系人: 张劲春

电话: (0769) 2119353

传真: (0769) 2119423

客户服务电话: 961130 (0769) 2413222

(35) 国都证券

联系地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人: 王少华

业务联系人: 马泽承

电话: (010) 64482828 转 390

传真: (010) 64482090

客服电话: 400-818-8118

(36) 万联证券

注册地址: 广州市东风东路 836 号东峻广场 3 座 34-35 楼

法定代表人: 陆景奎

联系人: 熊辉

电话: (020) 87693617

传真: (020) 87691530

(37) 中国建设银行

办公地址: 北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人: 王洪章

客户服务电话: 95533

传真: (010) 67598409

联系人: 曲华蕊

(38) 中信证券 (浙江) 有限责任公司

办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19 层、20 层

法定代表人: 沈强

联系人: 龚晓军

电话: (0571) 85783750

传真: (0571) 85783771

(39) 宏源证券

办公地址: 北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人: 冯戎

联系人: 张智红

电话: (010) 62267799 转 6416

传真: (010) 62294470

(40) 华林证券

联系地址: 深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5 楼

法定代表人: 姚桥盛

联系人: 杨玲

电话: (0755) 82707855

传真: (0755) 82707850

(41) 中信银行

注册地址: 北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座

法定代表人: 孔丹

联系人: 秦莉

电话: (010) 65541405

传真: (010) 65541281

(42) 中国银行

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人: 肖钢

传真: (010) 66594946

客服电话: 95566

(43) 中国民生银行

注册地址: 北京市东城区正义路甲 4 号

法定代表人: 董文标

联系人: 吴杰

电话: 95568

(44) 华龙证券

办公地址: 甘肃省兰州市静宁路 308 号

法定代表人: 李晓安

联系人: 李昕田

电 话: (0931) 8888088, (0931) 4890619

传 真: (0931) 4890515

(45) 中信万通证券

办公地址: 青岛市东海西路 28 号龙翔广场

法定代表人: 史洁民

联系人: 丁韶燕

电话: 96577

(46) 安信证券

注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、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 层、28 层 A02 单元

法人代表人: 牛冠兴

联系人: 李瑾

电话: (0755) 82825551

传真: (0755) 82558355

客服热线: 4008001001

(47) 光大银行

注册地址: 北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人: 唐双宁

电话: (010) 68098778

传真: (010) 68560661

联系人: 李伟

客户服务电话: 95595

(48) 西部证券

注册地址: 西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人: 刘建武

电话: (029) 87406172

传真: (029) 87406387

联系人: 黄晓军

客户服务电话: (029) 95582

(49) 方正证券

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

法定代表人：雷杰

联系人：邢铁英

电话：(0571) 87782047

传真：(0571) 87782011

(50) 深圳平安银行

注册地址：深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

联系人：霍兆龙

电话：(0755) 25859591

传真：(0755) 25879453

客服热线：40066-99999

(51) 上海证券

办公地址：上海市银城中路 168 号

法定代表人：陈辛

电话：(021) 68475888

联系人：张萍

(52) 天相投资

办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

电话：(010) 66045577

联系人：林爽

(53) 信达证券

办公地址：北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层

法定代表人：张志刚

电话：400-800-8899

联系人：唐静

(54) 华福证券有限责任公司

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

电话：(0591) 87383623

联系人：张腾

(55) 中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市湖贝路 1030 号海龙王大厦

办公地址：北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦

法定代表人：王东明

电话：(010) 84864818 转 63266

传真：(010) 84865560

联系人：陈忠

客服热线：(010) 84868330

(56) 恒泰长财证券有限责任公司

办公地址：吉林省长春市珠江路 439 号

法定代表人：赵培武

电话：(0431) 82951765

联系人：吴德森

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。

(二) 注册登记人

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融街 27 号投资广场 22、23 层

法定代表人：陈耀先

联系人：朱立元

电话：(010) 58598839

传真：(010) 58598907

(三) 律师事务所

名称：广东嘉得信律师事务所

注册地址：深圳市红岭中路国信证券大厦12楼

办公地址：深圳市红岭中路国信证券大厦12楼

法定代表人：闵齐双

联系人：尹小胜

经办律师：闵齐双 刘少华 尹小胜 崔卫群

电话：(0755) 33382888 (总机) (0755) 33033020 (直线) 15302728596

传真：(0755) 33033086

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 1604-1608 室

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼 (邮编：200021)

法人代表：杨绍信

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：薛竞、刘莉

经办注册会计师：薛竞、王灵

五、基金名称

融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)

六、基金类型

上市契约型开放式

七、基金的投资目标

本基金为增强型指数基金。在控制股票投资组合相对巨潮 100 目标指数跟踪误差的基础上，力求获得超越巨潮 100 目标指数的投资收益，追求长期的资本增值。本基金谋求分享中国经济持续、稳定增长和中国证券市场发展的成果，实现基金财产的长期增长，为投资者带来稳定的回报。

八、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括投资于国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金的股票投资部分主要投资于目标指数的成份股票，包括巨潮 100 指数的成份股和预期将要被选入巨潮 100 指数的股票，本基金还可适当投资一级市场的股票（包括新股与增发）。非成份股的投资比例控制在基金资产净值的 10% 以内，但成份股更换期因指数成份股调整而进行的非成份股投资不在此比例限制范围之内。

九、基金的投资策略

本基金为增强型指数基金，在控制股票投资组合相对目标指数偏离风险的基础上，力争获得超越目标指数的投资收益。基金以指数化分散投资为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动调整，在量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在偏离风险及超额收益间的最佳匹配。为控制基金偏离目标指数的风险，本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制在 0.5%。

(一) 决策依据和决策程序

(1) 研究部提供宏观经济、行业分析以及公司的研究报告；金融工程小组利用量化模型进行投资组合优化和跟踪误差模拟测算，在此基础上进行投资论证，做出投资建议提交给基金经理，并为投资决策委员会提供资产配置的决策依据。

(2) 基金经理根据金融工程提交的指数组合优化及风险测算的结果以及研究部提交的投资建议初步决定下一阶段的投资组合，形成资产配置提案报投资决策委员会。

(3) 投资决策委员会审定基金经理提交的资产配置提案形成资产配置计划书。

(4) 基金经理根据投资决策委员会的决策制定相应的指数化投资组合投资方案，对超出基金经理权限的投资决策须报投资决策委员会审议核准。

(5) 基金经理根据投资组合方案制定具体的操作计划，并以投资指令的形式下达至交易部。

(6) 交易部依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

(7) 金融工程小组负责对基金组合的跟踪误差和偏离风险进行评估，定期提交组合跟踪误差归因分析报告和风险监控报告。在跟踪误差超过一定范围时，通知基金经理和相关部門及时进行投资组合的调整。

(8) 风险控制委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督。

(二) 投资管理的方法和标准

(1) 仓位控制策略

本基金投资于股票的资产比例范围为基金资产净值的 90%—95%；保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的资产比例合计不低于基金资产净值的 5%。实际运作过程中，由于受市场价格波动、股票交易的零股限制、基金申购赎回情况等因素的影响，基金的资产未达限定比例要求的，基金经理将对此进行实时监控并在十个交易日内做出相应的调整。

(2) 指数化投资策略

本基金以复制法作为股票指数化投资部分的主要投资方法。对于因流动性等原因导致基金管理人无法复制巨潮 100 指数的情况, 本基金将采用剩余替换等方法避免由此引起的跟踪误差扩大。

(3) 增强型投资策略

本基金以指数化投资为主, 基于中国证券市场作为一个新兴市场并非完全有效及指数编制本身的局限性, 在严格控制跟踪误差的前提下, 辅以有限度的增强投资及一级市场股票投资。其目的有二, 一是为了在跟踪目标指数的基础上适度获取超额收益; 二是抵消基金运作中不可避免的负向超额收益, 如管理费、托管费、交易费用等。增强操作的依据是:

1) 行业基本面信息的深入挖掘及行业景气周期的综合判断。

2) 公司基本面的挖掘及绝对、相对估值研究。

3) 股票的流动性分析。主要根据对当时市场成交活跃程度及股票过往的平均换手率、交易量等因素的分析, 对个股的流动性及其对指数基金组合构建及调整有可能产生的影响进行分析预测。

4) 指数成份股的提前或延后更换。本基金将根据目标指数的编制规则, 预测指数成份股可能发生的变动以及对股价有可能产生的影响, 适度提前或延后成份股的调整。

(4) 其他投资策略

本基金将审慎投资于中国证监会核准的其他金融工具, 以减少基金财产的风险并提高收益。

(三) 资产支持证券的投资策略、风险控制措施及投资比例

1、投资策略

基金管理人在确保与基金投资目标相一致的前提下, 可本着谨慎和风险可控的原则, 为取得与承担风险相称的收益, 投资于资产支持证券。

(1) 买入持有策略

基金可在与投资目标一致的前提下, 买入并持有资产支持证券, 以获取相应的利息收入。

(2) 利率预期策略

根据对利率趋势、提前还款率等的预期, 预测资产支持证券收益率的变化趋势, 从而决定对资产支持证券的买入或卖出。

(3) 信用利差策略

通过对资产支持证券的信用评估, 分析预期违约率和违约损失率的变化趋势, 评估其信用利差是否合理, 并预测其变化趋势, 通过其信用质量的改善和信用利差的缩小获利。

(4) 相对价值策略

基金通过计算资产支持证券的名义利差、静态利差及期权调整利差等指标, 将资产支持证券的收益风险特征与其他资产类别和债券的收益风险比较, 确定其是否具有相对价值, 从而决定对其整体或个券的买入和卖出。

2、风险控制措施

(1) 通过严格的投资流程控制投资风险, 基金经理及有关人员必须严格执行投资授权制度。

(2) 在投资资产支持证券时, 首先应由固定收益研究员提出资产支持证券产品的风险收益报告和投资建议, 基金经理根据投委会决定的资产配置计划和相应的投资权限, 参考固定收益研究员的资产支持证券的风险收益报告, 充分评估资产支持证券的风险收益特征, 确定具体投资方案, 在严格控制风险的前提下, 谨慎进行投资。

(3) 交易部负责具体的交易执行, 同时履行一线监控的职责, 监控内容包括基金资产支持证券投资比例及交易对手风险控制等。

(4) 固定收益小组对资产支持证券投资进行风险和绩效评估, 密切跟踪影响基金所投资资产支持证券信用质量变化的各种因素, 并在投资中进行相应操作, 以规避信用风险的上升。

(5) 固定收益小组负责不断完善资产支持证券定价模型, 并评估模型风险。密切跟踪影响资产支持证券收益率变化的各种因素, 并评估其对资产支持证券持有期收益的影响, 并进行相应的投资操作。

(6) 基金经理在投资决策时将评估资产支持证券的上市等流动性安排, 并考虑其对基金资产流动性的影响, 分散投资, 确保所投资的资产支持证券具有适当的流动性。

(7) 基金经理将密切关注影响债务人提前偿还的各种因素, 并评估其对资产支持证券投资价值的影响, 并进行相应的投资决策。

(8) 基金管理人将不断完善内部控制制度及相应技术手段, 使基金相关操作以谨慎安全的方式进行, 确保基金及持有人利益得到保障。

(9) 基金管理人将严格审查所投资资产支持证券的法律文件, 确保各业务环节都有适当的法律保障。

3、本基金可投资于各剩余期限的资产支持证券，除必须遵守本基金合同中已有的投资比例限制之外，还应遵守下述限制规定：

(1) 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%。

(2) 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基金资产净值的 10%。

(3) 与基金管理人管理的其他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%。

(4) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%。

(5) 因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资资产支持证券不符合上述第（2）项和第（4）项规定的比例，基金管理人将在 10 交易日内调整完毕。

(6) 投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。本基金应投资于信用级别为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持债券。在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。

十、基金的业绩比较基准

巨潮 100 指数收益率*95%+银行同业存款利率*5%。

十一、基金的风险收益特征

风险和预期收益率接近市场平均水平。

十二、基金投资组合报告

本基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定，于 2012 年 6 月 5 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本投资组合报告所载数据截至 2012 年 3 月 31 日。

1、期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,964,980,272.07	94.71
	其中：股票	1,964,980,272.07	94.71
2	固定收益投资	80,176,000.00	3.86
	其中：债券	80,176,000.00	3.86
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-

	其中:买断式回购的买入返售 金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	26,803,292.58	1.29
6	其他资产	2,684,002.33	0.13
7	合计	2,074,643,566.98	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 指数投资部分

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,590,456.00	0.17
B	采掘业	242,098,606.02	11.69
C	制造业	540,883,078.61	26.13
C0	食品、饮料	157,805,091.79	7.62
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	27,294,897.85	1.32
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	156,475,542.87	7.56
C7	机械、设备、仪表	172,883,209.05	8.35
C8	医药、生物制品	26,424,337.05	1.28
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	48,309,014.67	2.33
E	建筑业	49,854,868.94	2.41
F	交通运输、仓储业	57,094,555.65	2.76
G	信息技术业	54,762,133.22	2.65
H	批发和零售贸易	51,704,303.29	2.50
I	金融、保险业	804,472,124.14	38.86
J	房地产业	105,850,745.55	5.11
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	6,360,385.98	0.31
	合计	1,964,980,272.07	94.91

(2) 积极投资部分

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

3、指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	8,500,489	101,155,819.10	4.89
2	600016	民生银行	14,045,872	88,067,617.44	4.25
3	601318	中国平安	2,177,059	79,636,818.22	3.85
4	601166	兴业银行	4,869,457	64,861,167.24	3.13
5	601328	交通银行	13,664,669	64,360,590.99	3.11
6	600000	浦发银行	7,080,622	63,229,954.46	3.05
7	600030	中信证券	5,199,762	60,265,241.58	2.91
8	600837	海通证券	6,279,302	56,576,511.02	2.73
9	600519	贵州茅台	250,634	49,364,872.64	2.38
10	000002	万科 A	5,687,093	47,089,130.04	2.27

积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,176,000.00	3.87
	其中：政策性金融债	80,176,000.00	3.87
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	80,176,000.00	3.87

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	110414	11 农发 14	800,000	80,176,000.00	3.87

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(2) 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

(3) 报告期末其他资产的构成如下：

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,035,601.47
5	应收申购款	148,400.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,684,002.33

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末股票中存在流通受限情况的说明

1) 指数投资部分前十名

本基金本报告期末指数投资部分前十名股票中不存在流通受限情况。

2) 积极投资部分前五名

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

十三、基金的业绩

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代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表如下：

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④

2005 年度 (2005 年 5 月 12 日至 2005 年 12 月 31 日)	6.11%	0.91%	4.77%	1.20%	1.34%	-0.29%
2006 年度	119.72%	1.37%	118.53%	1.30%	1.19%	0.07%
2007 年度	136.63%	2.17%	134.65%	2.18%	1.98%	-0.01%
2008 年度	-63.96%	2.91%	-62.78%	2.88%	-1.18%	0.03%
2009 年度	84.92%	1.96%	85.62%	1.94%	-0.70%	0.02%
2010 年度	-18.39%	1.53%	-17.13%	1.51%	-1.26%	0.02%
2011 年度	-20.53%	1.22%	-18.82%	1.21%	-1.71%	0.01%

十四、基金份额的申购和赎回

(一) 申购和赎回场所

- 1、本公司直销网点；
- 2、经本公司委托，具有销售本基金资格的商业银行或其他机构的营业网点；
- 3、深圳证券交易所，投资者申购、赎回基金份额应当使用在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户。

(二) 申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及时间

申购、赎回的开放日为证券交易所交易日，在开放日的具体业务办理时间由基金管理人与销售代理人约定。

投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

2、申购开始日

本基金合同生效后，开始接受申购的时间为 2005 年 6 月 16 日，于 2008 年 11 月 7 日开通场外后端收费申购业务。

3、赎回开始日

本基金合同生效后，开始接受赎回的时间为 2005 年 6 月 16 日。

(三) 申购和赎回的原则

- 1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日的基金份额净值为基准进行计算。
- 2、在场外，实行“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；在场内，基金份额的申购以金额申报，申报单位为一元人民币；赎回以份额申报，申报单位为一基金份额。
- 3、当日的申购、赎回申请可以在基金管理人或深圳证券交易所规定的时间以前撤销。
- 4、基金管理人可根据基金运作的实际情况更改上述原则。基金管理人必须于新规则开始实施日前 3 个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

(四) 申购限额

1、场外

投资者在代销网点和网上直销的每次最低申购金额为 1,000 元人民币 (含申购费, 定期定额申购每次最低金额为 100 元人民币); 在直销机构的直销柜台单笔最低申购金额为 10 万元人民币 (含申购费);

2、场内

投资者场内每次最低申购金额为 1000 元 (含申购费)。

(五) 申购和赎回的程序

1、申请方式: 书面申请、委托证券经营机构向深圳证券交易所交易系统申报或管理人公布的其他方式。

2、确认与通知: 当日 (T 日) 在规定时间内之前提交的申请, 投资者可在 T+2 日到网点查询申购、赎回的确认情况。

3、申购与赎回款项支付的方式与时间: 基金申购采取全额缴款的方式, 若申购资金在规定时间内未全额到账 (指到达基金份额发售机构指定申购账户) 则申购不成功。若申购不成功或无效, 申购款项将退回投资者账户。基金份额持有人赎回本基金申请确认后, 赎回款项将在 T+5 日内划往基金份额持有人账户。在发生延期赎回的情形时, 款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

(六) 申购和赎回的数额和价格

1、本基金代销机构首次申购和追加申购的最低金额按照基金管理人和代销机构约定的为准。本基金直销网点最低申购金额由基金管理人制定和调整;

2、场外赎回的最低份额为 300 份基金份额, 基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回; 场内赎回申请不得低于 300 份基金份额;

3、基金管理人可根据市场情况, 调整申购、赎回份额的数量限制, 调整前的 3 个工作日基金管理人必须在至少一种指定报刊和网站上刊登公告;

4、申购份额及余额的处理方式: 场外申购有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后, 以当日基金份额净值为基准计算并保留小数点后两位, 小数点两位以后的部分四舍五入, 由此产生的误差归基金资产。场内申购份额保留到整数位, 零碎份额对应的资金返还至投资者资金账户。

5、赎回金额的处理方式：本基金的赎回金额按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值为基准计算并扣除相应的费用。计算结果保留小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差归基金资产。

6、申购费率：

(1) 本基金的场内申购采用前端收费模式；场外申购采用前端收费和后端收费两种收费模式，投资人可自行选择。申购费用用于基金管理人、基金销售机构的基金销售费用。

(2) 本基金的前端申购费按申购金额采用比例费率，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。费率表如下：

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万	1.5%
100 万 ≤ M < 1000 万	1.2%
1000 万 ≤ M < 2000 万	0.6%
M ≥ 2000 万	单笔 2000 元

(3) 本基金的后端申购费以持有期限分档设置不同的费率水平。费率表如下：

持有期限 (T)	后端申购费率
T < 1 年	1.80%
1 年 ≤ T < 2 年	1.35%
2 年 ≤ T < 3 年	0.90%
3 年 ≤ T < 4 年	0.45%
T ≥ 4 年	0

7、本基金的赎回费率不高于 0.5%。

场外赎回费率随持有时间的增加而减少，如下表所示：

申请份额持有时间	赎回费率
持有时间 < 1 年	0.5%
1 年 ≤ 持有时间 < 3 年	0.25%
持有时间 ≥ 3 年	0

场内赎回费率目前统一为 0.5%。在深圳证券交易所、注册登记人等相关机构技术条件许可的情况下，场内赎回费率结构可参照场外赎回费率，具体请关注本基金相关公告。

8、申购份额的计算方法如下：

(1) 场外申购份额的计算

1) 前端收费模式

如果投资者选择缴纳前端申购费用，则申购份额的计算方法如下：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日基金份额净值

例 1: 假设申购费率为 1.5%, 申购当日基金份额净值为 1.200 元, 投资者申购 5,000 元, 并且选择缴纳前端申购费, 则申购情况如下:

$$\text{净申购金额} = 5,000 / (1 + 1.5\%) = 4,926.11 \text{ 元};$$

$$\text{申购费用} = 5,000 - 4,926.11 = 73.89 \text{ 元};$$

$$\text{申购份额} = 4,926.11 / 1.200 = 4,105.09 \text{ 份}$$

注: 由于不同的申购金额所对应的费率不同, 该例仅作参考。

2) 后端收费模式

如果投资者选择缴纳后端申购费用, 则申购份额的计算方法如下:

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{申购日基金份额净值}$$

例 2: 假设申购当日基金份额净值为 1.200 元, 投资者申购 5,000 元, 并且选择缴纳后端申购费, 则申购情况如下:

$$\text{申购份额} = 5,000 / 1.200 = 4,166.67 \text{ 份}。$$

申购份额以四舍五入的方法保留小数点后两位, 由此产生的差额归基金资产。

(2) 场内申购份额的计算

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购手续费} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

场内申购份额保留到整数位, 零碎份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例 3: 某投资者通过场内投资 1 万元申购融通巨潮 100 指数基金, 对应的申购费率为 1.5%, 申购当日基金份额净值为 1.025 元, 则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为:

$$\text{净申购金额} = 10,000 / (1 + 1.5\%) = 9,852.22 \text{ 元}$$

$$\text{申购手续费} = 10,000 - 9,852.22 = 147.78 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,852.22 / 1.025 = 9,611.92 \text{ 份}$$

因场内份额保留至整数份, 故投资者申购所得份额为 9,611 份, 不足 1 份部分的申购资金零头返还给投资者。

$$\text{实际净申购金额} = 9,611 \times 1.025 = 9,851.28 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 10,000 - 9,851.28 - 147.78 = 0.94 \text{ 元}$$

9、赎回金额的计算方法如下:

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以赎回当日基金份额净值为基准按四舍五入的方法计算并扣除相应的费用。

1) 前端收费模式

赎回总金额 = 赎回份额 × 赎回当日基金份额净值

赎回费 = 赎回总金额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费

例 4: 假设赎回费率为 0.3%，赎回当日基金份额净值为 1.200 元，投资者赎回前端收费份额 10,000 份，则赎回情况如下：

赎回总金额 = 10,000 × 1.200 元 = 12,000 元

赎回费 = 12,000 × 0.3% = 36 元

赎回金额 = 12,000 - 36 = 11,964 元

注：由于持有基金份额时间不同所对应的费率不相同，该例仅作参考。

2) 后端收费模式

赎回总金额 = 赎回份额 × 赎回当日基金份额净值

后端申（认）购费 = 赎回份额 × 最小值 [申（认）购当日基金份额净值，赎回当日基金份额净值] × 对应的后端申（认）购费率

赎回费 = 赎回总金额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总金额 - 后端申（认）购费 - 赎回费

例 5: 假如赎回费率为 0.3%，赎回当日基金份额净值为 1.200 元，投资者赎回后端收费份额 10,000 份，该笔份额为认购所得，对应的后端认购费率为 1.6%，则赎回情况如下：

赎回总金额 = 10,000 × 1.200 元 = 12,000 元

后端认购费 = 10,000 × 最小值 (1.000, 1.200) × 1.6% = 160 元

赎回费 = 12,000 × 0.3% = 36 元

赎回金额 = 12,000 - 160 - 36 = 11,804 元

注：由于持有基金份额时间不同所对应的费率不相同，该例仅作参考。

例 6: 假如赎回费率为 0.3%，赎回当日基金份额净值为 1.200 元，投资者赎回后端收费份额 10,000 份，该笔份额为申购所得，对应的申购日基金份额净值为 1.100 元，对应的后端申购费率为 1.9%，则赎回情况如下：

赎回总金额 = 10,000 × 1.200 元 = 12,000 元

后端申购费 = 10,000 × 最小值 (1.100, 1.200) × 1.9% = 209 元

赎回费 = 12,000 × 0.3% = 36 元

赎回金额 = 12,000 - 209 - 36 = 11,755 元

注：由于持有基金份额时间不同所对应的费率不相同，该例仅作参考。

赎回金额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额归基金资产。

10、基金份额净值的计算公式：

基金份额净值 = (基金总资产 - 基金总负债) / 已售出的基金份额总数

T 日基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

(七) 申购和赎回的注册登记

投资者 T 日申购基金成功后，注册登记人在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额；投资者 T 日赎回基金成功后，注册登记人在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于实施日前 3 个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

(八) 拒绝或暂停接受申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可暂停或拒绝接受基金投资者的申购申请：

1、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；

2、基金场内交易停牌时；

3、不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

4、证券交易所非正常停市；

5、有关法律、法规规定或中国证监会认定的其他暂停申购情形；

6、当基金管理人认为某笔申购申请会影响到其他基金份额持有人利益时，可拒绝该笔申购申请。

发生上述 1 到 5 项暂停申购情形时，基金管理人应当立即在指定报刊和网站上刊登暂停申购公告；

发生上述第 6 项拒绝申购情形时，申购款项将全额退还投资者。

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金申购，应当报中国证监会核准；经核准后，基金管理人应当立即在指定报刊和网站上刊登暂停申购公告。

(九) 暂停赎回或延续支付赎回款项的情形

本基金必须保持足够的现金或者政府债券, 以备支付基金份额持有人的赎回款项。但是发生下列情况时, 基金管理人可暂停接受基金投资者的赎回申请:

- 1、不可抗力的原因导致基金无法正常工作;
- 2、证券交易所非正常停市;
- 3、因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回, 导致本基金的现金支付出现困难;
- 4、基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人合法权益的基金赎回行为;
- 5、基金场内交易停牌时;
- 6、有关法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时, 基金管理人在当日向中国证监会报告, 已接受的申请, 基金管理人足额兑付; 如暂时不能足额兑付, 可兑付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人, 未兑付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以兑付, 并以基金份额净值为依据计算赎回金额。投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项, 但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金赎回, 应当报中国证监会核准; 经核准后, 基金管理人应当立即在指定报刊和网站上刊登暂停公告。

(十) 巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

指在单个开放日内, 本基金净赎回申请份额 (该基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额) 与净转出申请份额 (该基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额) 之和超过上一开放日基金总份额 10% 的情形。

2、巨额赎回的处理方式

(1) 全额赎回: 当基金管理人认为有能力兑付投资者的赎回申请时, 按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回: 当基金管理人认为兑付投资者的赎回申请有困难或认为兑付投资者的赎回申请而进行的资产变现可能对基金的资产净值造成较大波动时, 基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下, 对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请, 按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例, 确定当日受理

的赎回份额；未受理部分可延迟至下一个开放日办理。转入下一个开放日的赎回申请不享有优先权并以该开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。但投资者在申请赎回时可选择将当日未获受理部分予以撤销。在发生巨额赎回的情况下，当日未获受理的场内赎回将自动撤销。

3、巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并部分延期赎回时，基金管理人应通过指定报刊和网站在 3 个证券交易所交易日内刊登公告，并说明有关处理方法。

本基金连续两个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在指定报刊和网站上进行公告。

(十一) 重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天，暂停结束后基金管理人应在至少一种指定报刊和网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告并公布最近一个工作日本基金的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 1 个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日本基金的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种指定报刊和网站上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日本基金的基金份额净值。

(十二) 基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记

1、基金份额的登记

本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买入的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。

2、系统内转托管

(1) 系统内转托管是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

(2) 份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构 (网点) 时, 销售机构 (网点) 之间不能通存通兑的, 可办理已持有基金份额的系统内转托管。

(3) 份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易的会员单位 (席位) 时, 可办理已持有基金份额的系统内转托管。

3、跨系统转登记

(1) 跨系统转登记是指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

(2) 本基金跨系统转登记的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。

十五、费用概览

(一) 与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费;
- (2) 基金托管人的托管费;
- (3) 基金的证券交易费用;
- (4) 基金合同生效后的信息披露费用;
- (5) 基金份额持有人大会费用;
- (6) 基金合同生效后的会计师费和律师费;
- (7) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的基金管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.3% 年费率计提。

基金管理费按前一日基金资产净值为基数计提。如费率为 1.3%，计算方法如下：

$$H = E \times 1.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提, 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令, 经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中支付给基金管理人指定的帐户, 若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延。

(2) 基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.2% 年费率计提。

在通常情况下, 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提, 按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令, 基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人, 若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延。

(3) 上述 1 中第 (3) - (7) 项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议规定, 按费用实际支出金额, 列入当期费用, 由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

基金成立前所产生的费用、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失, 以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

(二) 与基金销售有关的费用

1、基金申购费

申购费率

本基金的前端申购费率不高于 1.5%, 随申购金额的增加而减少; 如下表所示:

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万	1.5%
100 万 ≤ M < 1000 万	1.2%
1000 万 ≤ M < 2000 万	0.6%
M ≥ 2000 万	单笔 2000 元

本基金的后端申购费率不高于 1.80%, 随持有时间的增加而减少; 如下表所示:

持有期限 (T)	后端申购费率
T < 1 年	1.80%
1 年 ≤ T < 2 年	1.35%
2 年 ≤ T < 3 年	0.90%
3 年 ≤ T < 4 年	0.45%
T ≥ 4 年	0

(2) 收取方式

申购发生时, 在申购金额中按照申购费率收取。

(3) 使用方式

本基金的申购费用可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、基金赎回费

(1) 赎回费率

场外赎回费率不高于 0.5%，随持有时间的增加而减少，如下表所示：

申请份额持有时间	赎回费率
持有时间 < 1 年	0.5%
1 年 ≤ 持有时间 < 3 年	0.25%
持有时间 ≥ 3 年	0

场内赎回费率目前统一为 0.5%。在深圳证券交易所、注册登记人等相关机构技术条件许可的情况下，场内赎回费率结构可参照场外赎回费率，具体请关注本基金相关公告。

(2) 收取方式

赎回发生时，在赎回金额中按照赎回费率收取。

(3) 使用方式

本基金的赎回费用由赎回人承担，在扣除销售代理费用和注册登记费等相关手续费后，余额不低于赎回费总额的 25%，并归入基金财产。

(三) 基金的税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十六、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金管理人于 2011 年 12 月 23 日刊登的本基金招募说明书进行了更新：

(一) 在“三、基金管理人”部分，对“(二) 主要人员情况”进行了更新；

1、更新了公司董事信息，新增施天涛先生为公司独立董事，强力先生不再担任公司独立董事，新增奚星华先生和裴布雷 (Blair Pickere11) 先生为公司董事，颜锡廉 (Allen Yan) 先生和刘汝军先生不再担任公司董事；

2、更新了“公司高级管理人员”部分内容，刘模林先生不再担任公司副总经理；

3、更新了“公司投资决策委员”成员组成。

(二) 在“四、基金托管人”部分，对基金托管人的基本情况及相关业务经营情况按照最新资料进行了更新；

(三) 在“五、相关服务机构”部分：

1、更新了直销机构相关信息；

2、华泰联合证券不再作为本基金的代销机构；中信金通证券更名为中信证券（浙江）有限责任公司；

3、改聘广东嘉得信律师事务所为本基金提供法律服务，康达律师事务所不再为本基金提供服务；

4、更新了会计师事务所的联系人和经办注册会计师。

（四）在“七、基金的投资”部分，更新了“基金投资组合报告”的内容，更新数据为本基金 2012 年第 1 季度报告中的投资组合数据；

（五）在“八、基金的业绩”部分，按规定要求对基金的投资业绩数据进行了列示，已经基金托管人复核；

（六）在“二十、其他应披露事项”部分，对自上次招募说明书截止日以来与本基金相关的基金公告进行了列表说明。

融通基金管理有限公司

2012 年 6 月 25 日