

# 融通创业板指数增强型证券投资基金更新招募说明书摘要

## 重要提示

融通创业板指数增强型证券投资基金（以下简称本基金）经中国证监会 2011 年 10 月 8 日证监许可[2011]1595 号文核准募集。本基金基金合同于 2012 年 4 月 6 日正式生效。

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，但中国证监会对本基金募集的核准，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。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》、《运作办法》、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。

投资有风险，投资者认购（或申购）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；基金管理人管理的其他基金的业绩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。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50% 的除外。

本招募说明书所载内容截止日为 2018 年 4 月 6 日，有关财务数据截止日为 2018 年 3 月 31 日，净值表现截止日为 2017 年 12 月 31 日（本招募说明书中的财务资料未经审计）。

## 一、基金合同生效日

2012 年 4 月 6 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

住所：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：高峰

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

电话：（0755）26947517

联系人：赖亮亮

注册资本：12500 万元人民币

股权结构：新时代证券股份有限公司 60%、日兴资产管理有限公司（NikkoAssetManagementCo.,Ltd.）40%。

### （二）主要人员情况

#### 1、现任董事情况

董事长高峰先生，金融学博士，现任融通基金管理有限公司董事长。历任大鹏证券投行部高级经理、业务董事，平安证券投行部副总经理，北京远略投资咨询有限公司总经理，深圳新华富时资产管理有限公司总经理。2015 年 7 月起至今，任公司董事长。

独立董事杜婕女士，经济学博士，民进会员，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，吉林大学教师、讲师、教授。2011 年 1 月至今，任公司独立董事。

独立董事田利辉先生，金融学博士后、执业律师，现任南开大学金融发展研究院教授。历任密歇根大学戴维德森研究所博士后研究员、北京大学光华管理学院副教授、南开大学金融发展研究院教授。2011 年 1 月至今，任公司独立董事。

独立董事施天涛先生，法学博士，现任清华大学法学院教授、法学院副院长、博士研究生导师、中国证券法学研究会和中国保险法学研究会副会长。2012年1月至今，任公司独立董事。

董事王利先生，工学学士，现任新时代证券股份有限公司总经理助理兼公司内核负责人、场外市场部负责人。历任中石化齐鲁分公司财务部会计，上海远东证券有限公司总经理助理兼稽核部总经理，新时代证券股份有限公司总经理助理兼合规管理部、法律事务部总经理。2018年2月至今，任公司董事。

董事杨宗兵先生，中国语言文学博士后，现任明天控股有限公司干部与业务管理中心副总裁。历任安徽省池州市第八中学高中语文教师，中国图书进出口(集团)总公司党委组织部部长，新兴际华集团有限公司党群工作部部长、党委书记、董事、集团党委副书记、机关党委书记（副厅级）。2018年3月至今，任公司董事。

董事王裕闵先生，工商管理学硕士，现任日兴资产管理有限公司副总裁、全球投资主管兼首席投资官（国际），兼任 ARKInvestmentManagementGPLLC 董事会列席代表。历任 MBank 分析员，FGIC（GECapital 通用资本的子公司）交易员，GeneralReinsurance 基金经理，CGAInvestmentManagement 高级基金经理，StructuredCreditPartnersLLC 联合创始人兼首席投资官，WachoviaCorporation 董事总经理兼全球结构信贷产品主管、董事总经理兼全球市场和投资银行业务亚洲主管，宏利资产管理（ManulifeAssetManagement）香港亚洲固定收益产品主管，日兴资产管理有限公司首席投资官（国际），日兴资产管理有限公司全球投资主管兼首席投资官（国际）。2018年3月至今，任公司董事。

董事 AllenYan（颜锡廉）先生，工商管理硕士，现任融通基金管理有限公司常务副总经理兼融通国际资产管理有限公司总经理。历任富达投资公司（美国波士顿）分析员、富达投资公司(日本东京)经理、日兴资产管理有限公司部长。2015年6月至今，任公司董事。

董事张帆先生，工商管理硕士，现任融通基金管理有限公司总经理。历任上海远东证券有限公司上海金桥路证券营业部总经理助理、经纪业务总部副总经理，新时代证券股份有限公司信阳北京大街证券营业部总经理、经纪业务管理总部董事总经理、总经理助理、副总经理职务。2017年6月起至今，任公司董事。

## 2、现任监事情况

监事刘宇先生，金融学硕士、计算机科学硕士，现任公司监察稽核部总经理。历任国信证券股份有限公司投资银行部项目助理、安永会计师事务所高级审计员、景顺长城基金管理有限公司法律监察稽核部副总监。2015年8月起至今，任公司监事。

## 3、公司高级管理人员情况

董事长高峰先生，金融学博士，现任融通基金管理有限公司董事长。历任大鹏证券投行部高级经理、业务董事，平安证券投行部副总经理，北京远略投资咨询有限公司总经理，深圳新华富时资产管理有限公司总经理。2015年7月起至今，任公司董事长。

总经理张帆先生，工商管理硕士，现任融通基金管理有限公司总经理。历任上海远东证券有限公司上海金桥路证券营业部总经理助理、经纪业务总部副总经理，新时代证券股份有限公司信阳北京大街证券营业部总经理、经纪业务管理总部董事总经理、总经理助理、副总经理职务。2017年6月起至今，任公司总经理。

常务副总经理 AllenYan（颜锡廉）先生，工商管理硕士。历任富达投资公司（美国波士顿）分析员、富达投资公司(日本东京)经理、日兴资产管理有限公司部长。2011年3月至今，任公司常务副总经理。

副总经理刘晓玲女士，金融学学士。历任博时基金管理有限公司零售业务部渠道总监，富国基金管理有限公司零售业务部负责人，泰康资产管理有限责任公司公募事业部市场总监。2015年9月起至今，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3月至今，任公司督察长。

## 4、基金经理

### （1）现任基金经理情况

蔡志伟先生，华南师范大学计算机硕士、广州大学计算机学士，金融风险管理师（FRM），7年证券投资

从业经历，具有基金从业资格。曾就职于汇丰软件开发广东有限公司任高级软件工程师(SSE)。2011年6月加入融通基金管理有限公司，历任风险管理专员、金融工程研究员，现任融通巨潮100指数(LOF)、融通深证成份指数、融通创业板指数基金的基金经理。

#### (2) 历任基金经理情况

自2012年4月6日起至2015年1月8日，由王建强先生和李勇先生共同担任本基金的基金经理。

自2015年1月9日起至2016年11月18日，由李勇先生担任本基金的基金经理。

自2016年11月19日起至2017年1月7日，由李勇先生和蔡志伟先生共同担任本基金的基金经理。

自2017年1月8日起至今，由蔡志伟先生担任本基金的基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

公司公募基金投资决策委员会成员：权益投资总监、基金经理邹曦先生，权益投资部总经理、基金经理张延闽先生，研究部总经理、基金经理付伟琦先生，研究部总监、基金经理余志勇先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金托管人

#### (一) 基金托管人基本情况

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：易会满

注册资本：人民币35,640,625.71万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

#### (二) 主要人员情况

截至2017年末，中国工商银行资产托管部共有员工230人，平均年龄33岁，95%以上员工拥有本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

#### (三) 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、基本养老保险、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2017年末，中国工商银行共托管证券投资基金815只。自2003年以来，中国工商银行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、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54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。

### 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

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：陈思辰

电话：（0755）26948034

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：100033

联系人：魏艳薇

联系电话：（010）66190989

传真：（010）88091635

（3）融通基金管理有限公司上海分公司

地址：上海市浦东新区银城中路 501 号上海中心大厦 34 层 3405 号

邮编：200120

联系人：刘佳佳

联系电话：（021）38424889

（4）融通基金管理有限公司网上直销

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：韦荣涛

联系电话：（0755）26947504

传真：（0755）26948079

## 2、代销机构

（1）中国工商银行股份有限公司

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：易会满

联系人：刘秀宇

客服电话：95588

（2）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：田国立

联系人：王琳

客服电话：（010）66275654；95533

（3）交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

联系人：陈铭铭

客服电话：（021）58781234；95559

（4）招商银行股份有限公司

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

客服电话：(0755)83198888；95555

（5）上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

联系人：张萍

客服电话：(021)68475888

(6)平安银行股份有限公司

注册地址：深南中路 1099 号平安银行大厦

办公地址：深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：谢永林

客服电话：40066-99999

联系人：张莉

(7)渤海银行股份有限公司

办公地址：天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人：刘宝凤

联系人：王宏

电话：(022) 58316666

传真：(022) 58316569

客服电话：4008888811

(8)中国邮政储蓄银行股份有限公司（仅代销前端）

注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

法定代表人：李国华

客服热线：95580

公司网站：[www.psbc.com](http://www.psbc.com)

(9)中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：李庆萍

联系人：李博

电话：(010) 65541585

(10)中国民生银行股份有限公司（仅代销前端）

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

联系人：董云巍

客服电话：95568

(11)包商银行股份有限公司（仅代销前端）

注册地址：内蒙古包头市青山区钢铁大街 6 号

办公地址：内蒙古包头市青山区钢铁大街 6 号

法定代表人：李镇西

联系人：张建鑫

电话：010-64816038

客户服务电话：95352

网址：[www.bsb.com.cn](http://www.bsb.com.cn);

(12)苏州银行股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

法定代表人：王兰凤

传真：0512-69868370

联系人：葛晓亮

电话：0512-69868519

客服热线：96067

网址：[www.suzhoubank.com](http://www.suzhoubank.com)。

(13) 恒丰银行股份有限公司（仅代销前端）

住所：山东省烟台市芝罘区南大街 248 号

法定代表人：蔡国华

联系人：甘学芳

联系电话：05352118050

客服电话：400-813-8888

公司网址：[www.egbank.com.cn](http://www.egbank.com.cn)

(14) 宁波银行股份有限公司

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号 24 层

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：95574

联系人：邱艇

电话：0574-87050397

(15) 兴业银行股份有限公司

办公地址：福建省福州市鼓楼区湖东路 154 号

法定代表人：高建平

联系电话：0591-87824863

客服热线：95561

公司网址：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

(16) 上海浦东发展银行股份有限公司（仅代销前端）

注册地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

客服热线：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)；

公司网站 [www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

(17) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(18) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 楼

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-089-1289

(19) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

法定代表人：汪静波

联系人：方成

电话：021-38602377

传真：021-38509777

（20）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

联系人：高莉莉

电话：（021）54509988

传真：（021）64383798

（21）和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

电话：0755-82721122-8625

客服电话：400-920-0022、021-20835588

（22）北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

法定代表人：闫振杰

电话：010-62020088

传真：010-62020355

客服电话：400-888-6661

（23）中期资产管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号

办公地址：北京市朝阳区麦子店西街 3 号新恒基大厦 15 层

法定代表人：姜新

电话：010-65807865

传真：010-65807864

联系人：郭爱丽

客服热线：010-59539901

公司网站：cifcofund.com

（24）深圳腾元基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 2028 号皇岗商务中心主楼 4F（07）单元

办公地址：深圳市福田区金田路 2028 号皇岗商务中心主楼 4F（07）单元

法定代表人：曾革

电话：0755-33376853

传真：0755-33065516

客服电话：4006-877-899

（25）北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208-1209 室

法定代表人：罗细安

电话：010-67000988

传真：010-67000988-6000

客户服务电话：400-001-8811

(26) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室  
办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼  
法定代表人：凌顺平  
联系人：胡璇  
联系电话：0571-88911818  
传真：0571-86800423  
客服电话：0571-889208974008-773-772

(27) 一路财富(北京)信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 室  
办公地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 室  
法定代表人：吴雪秀  
传真：010-88312885  
联系人：苏昊  
客服电话：400-0011-566

(28) 嘉实财富管理有限公司（仅代销前端）

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元  
办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元、北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层  
法定代表人：赵学军  
联系人：景琪  
电话：021-20289890  
传真：021-20280110  
客户服务电话：400-021-8850

(29) 中国国际期货有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 1 层、2 层、9 层、11 层、12 层  
办公地址：北京市朝阳区麦子店西路 3 号新恒基国际大厦 15 层  
法定代表人：王兵  
联系人：赵森  
电话：010-59539864  
传真：010-59539806  
客户服务电话：95162

(30) 北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012  
办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012  
法定代表人：赵荣春  
电话：010-57418813  
传真：010-57569671  
联系人：崔丁元  
客服热线：4008936885  
公司网站：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

(31) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室  
办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼



法定代表人：李兴春

电话：021-50583533

传真：021-50583633

联系人：曹怡晨

客服热线：400-921-7755

公司网站：<http://a.leadfund.com.cn/>

(32) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504

法定代表人：陈洪生

联系人：梁云波

联系电话：0592-3122679

传真：0592-3122701

客服热线：0592-3122716

公司网站：[www.xds.com.cn](http://www.xds.com.cn)

(33) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 层

法定代表人：冯修敏

电话：021-33323999

传真：021-33323830

联系人：陈云卉

客服热线：400-820-2819

公司网站：[www.fund.bundtrade.com](http://www.fund.bundtrade.com)

(34) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505 室

法定代表人：林义相

电话：010-66045777

传真：010-66045518

联系人：谭磊

客服热线：010-66045678

公司网站：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)

(35) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：杨懿

联系人：文雯

电话：010-83363101

(36) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室

法定代表人：刘鹏宇

电话：0755-83999907-815

传真：0755-83999926

联系人: 马力佳

客服热线: 0755-83999907

公司网站: [www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

(37) 上海陆金所基金销售有限公司 (仅代销前端)

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人: 郭坚

联系人: 宁博宇

电话: 021-20665952

客户服务电话: 4008219031

公司网站: [www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(38) 珠海盈米财富管理有限公司 (仅代销前端)

注册地址: 珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人: 肖雯

传真: 020-89629011

联系人: 黄敏嫦

电话: 020-89629099

客服热线: 020-89629066

(39) 上海万得基金销售有限公司

注册地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址: 上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼

法定代表人: 王廷富

电话: 021-51327185

传真: 021-50710161

联系人: 姜吉灵

客服热线: 400-821-0203

网址: [www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

(40) 大泰金石基金销售有限公司

办公地址: 南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

法定代表人: 袁顾明

联系人: 何庭宇

电话: 021-20324153

网址: <http://www.dtfunds.com>

(41) 奕丰金融服务 (深圳) 有限公司

注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室 (入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址: 深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115 室, 1116 室及 1307 室

法定代表人: TANYIKUAN

电话: 0755-89460500

传真: 0755-21674453

联系人: 叶健

客服热线: 400-684-0500

公司网站: [www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

(42) 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室 (入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址：深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23A

法定代表人：高锋

电话：0755-83655588

传真：0755-83655518

联系人：廖苑兰

客服热线：4008048688

公司网站：www.keynesasset.com

(43) 北京汇成基金销售有限公司

地址：北京市海淀区中关村 e 世界 A 座 1108 室

法人代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

北京汇成客户服务电话：400-619-9059

网址：www.fundzone.cn

(44) 天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 9 层

法定代表人：丁东华

电话：010-59287984

传真：010-59287825

联系人：郭宝亮

客服热线：400-111-0889

网址：www.gomefund.com

(45) 上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

法定代表人：黄欣

电话：021-33768132

传真：021-33768132-802

联系人：戴珉微

客服热线：400-6767-523

公司网站：www.zzwealth.cn

(46) 北京虹点基金销售有限公司（仅代销前端）

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：胡伟

电话：010-65951887

传真：010-65951887

联系人：葛亮

客服热线：400-618-0707

网址：www.hongdianfund.com/

(47) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司（仅代销前端）

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址：北京市亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号京东集团总部 A 做 17 层

法定代表人：陈超

电话：4000988511/4000888816

传真：010-89188000

联系人：徐伯宇

客服热线：95518

公司网站：jr.jd.com

（48）深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

网址：www.zlfund.cn

（49）通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路 799 号 3 号楼 9 楼

法定代表人：马刚

联系人：杨徐霆

电话：021-60818249

客服热线：95156

网址：www.tonghuafund.com。

（50）华瑞保险销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 501 号上海中心大厦 32 层

法人代表：路昊

联系人：茆勇强

客服电话：400-111-5818

网址：www.huaruisales.com

（51）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

电话：021-20213600

传真：021-68596916

联系人：张茹

客服热线：400-700-9665

公司网站：www.ehowbuy.com

（52）大河财富基金销售有限公司（仅代销前端）

注册地址：贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号

办公地址：贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号

法定代表人：王荻

联系人：方凯鑫

电话：0851-88405606

传真：0851-88405599

客户服务电话：0851-88235678

网址: [www.urainf.com](http://www.urainf.com)

(53) 北京植信基金销售有限公司 (仅代销前端)

注册地址: 北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址: 北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人: 于龙

联系人: 吴鹏

电话: 010-56075718

传真: 010-67767615

客户服务电话: 4006-802-123

网址: [www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

(54) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址: 上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

邮编: 200335

法定代表人: 燕斌

联系人: 兰敏

电话: 021-52822063

传真: 021-52975270

客服电话: 400-166-6788

公司网址: [www.66liantai.com](http://www.66liantai.com)

(55) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司 (仅代销前端)

注册地址: 北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址: 北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人: 钱昊旻

电话: 010-59336539

传真: 010-59336500

联系人: 徐英

客服热线: 4008-909-998

网址: [www.jnlc.com](http://www.jnlc.com)

(56) 天津万家财富资产管理有限公司

注册地址: 天津自贸区(中心商务区)迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址: 北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人: 李修辞

电话: 010-59013828

传真: 010-59013707

联系人: 王芳芳

客服热线: 010-59013842

公司网站: <http://www.wanjiawealth.com/>

(57) 上海华夏财富投资管理有限公司 (仅代销前端)

注册地址: 上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

办公地址: 北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人: 毛淮平

电话: 010-88066632

传真: 010-63136184

联系人：仲秋玥

客服热线：400-817-5666

公司网站：[www.amcfortune.com](http://www.amcfortune.com)

(58)国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

法定代表人：杨德红

联系人：钟伟镇

电话：（021）62580818

客服电话：4008888666

(59)中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

联系人：刘畅

电话：（010）85130236

客服电话：400-8888-108

(60)广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区河北路 183-187 号大都会广场 43 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：（020）87558888-8333

客服电话：95575

(61)中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

电话：（010）66568450

客服电话：4008-888-8888

(62)申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：李梅

联系人：李玉婷

电话：（021）33388215

客服电话：95523 或 4008895523

(63)长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市江汉区新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

联系人：奚博宇

电话：021-68751860

客服电话：95579 或 4008-888-999

(64)万联证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层

法定代表人：张建军

联系人：罗创斌

电话：(020)38286651

客服电话:400-8888-133

(65) 渤海证券股份有限公司

注册地址: 天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人: 王春峰

联系人: 王星

电话: (022) 28451709

客服电话: 4006515988

(66) 华泰证券股份有限公司

注册地址: 江苏省南京市江东中路 228 号

法定代表人: 周易

联系人: 庞晓芸

电话: (0755) 82492193

客服电话: 95597

(67) 东吴证券股份有限公司

注册地址: 苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人: 范力

联系人: 方晓丹

电话: (0512) 65581136

客服电话: 4008601555

(68) 信达证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人: 张志刚

联系人: 尹旭航

联系电话: (010) 63080994

客服电话: 4008008899

(69) 东北证券股份有限公司

注册地址: 长春市人民大街 1138 号

法定代表人: 李福春

联系人: 安岩岩

电话: (0431) 85096517

客服电话: 4006000686

(70) 新时代证券股份有限公司

注册地址: 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人: 叶顺德

联系人: 田芳芳

电话: (010) 83561146

客服热线: 400-6989-898

(71) 平安证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区中心区金田路荣超大厦 4036 号 16-20 层

法定代表人: 曹实凡

联系人: 周一涵

电话: 021-38637436

客服电话: 95511-8

(72) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

法定代表人：何春梅

联系人：牛孟宇

联系电话：（0755）83707413

客服电话：95563 或 0771-5539032

（73）恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座光大银行办公楼 14-18 楼

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

电话：（0471）4972343

客服电话：400-196-6188

（74）国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦

法定代表人：徐丽峰

联系人：周欣玲

电话：（0791）86283080

客服电话：4008222111

（75）第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层 F

法定代表人：刘学民

联系人：李若晨

电话：（0755）25831754

客服电话：4008881888，95358

（76）华福证券有限责任公司

注册地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：（0591）87383623

客服电话：（0591）96326

（77）华龙证券股份有限公司

注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

法定代表人：李晓安

联系人：邓鹏怡

电话：（0931）4890208

客服电话：96668

（78）太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

法定代表人：李长伟

联系人：王婧

电话：010-88321613

客服电话：4006-650-999

（79）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人：何如



联系人：李颖

电话：（0755）82134993

客服热线：800-8108-86895536

（80）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：霍达

联系人：黄蝉君

电话：（0755）82943511

客服热线：95565、400-8888-111

（81）国都证券股份有限公司

注册地址：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：常喆

联系人：戈文

电话：（010）84183389

客服热线：400-818-8118

（82）中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

联系人：秦朗

电话：010-85679888-6035

客服电话：4009101166

（83）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

电话：028-86690057

联系人：刘婧漪

客服电话：4006-600109

（84）中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

电话：0755-82791065

客服热线：4009908826

（85）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

联系人：李芳芳

电话：（021）22169081

客服热线：95525

（86）中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

电话：021-20315117

客户服务电话：95538

(87) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

法定代表人：余维佳

联系人：张煜

电话：023-63786141

客服电话：4008096096

(88) 中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：王东明

联系人：马静懿

电话：（010）60838995

客服热线：0755-23835888

(89) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法人代表：杨宝林

联系人：刘宏莹

电话：（0532）85023924

客服电话：95548

(90) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 28 层

法定代表人：蒋煜

联系人：尚瑾

客服电话：4008188866

(二) 注册登记机构

融通基金管理有限公司

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：高峰

电话：（0755）26948071

联系人：杜嘉

(三) 律师事务所

名称：广东嘉得信律师事务所

注册地址：深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场 A 座 201

办公地址：深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场 A 座 201

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）075533033096（直线）13480989076

传真：（0755）33033086

(四) 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）

注册地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：俞伟敏

经办注册会计师：陈玲、俞伟敏

## 五、基金的名称

融通创业板指数增强型证券投资基金

## 六、基金的类型

契约性开放式

## 七、基金的投资目标

本基金在基金合同规定的范围内，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，结合增强收益的主动投资，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度控制在 0.5% 以内、年化跟踪误差控制在 7.75% 以内、基金总体投资业绩超越创业板指数的表现。

## 八、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。投资于股票资产不低于基金资产净值的 90%，其中投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。

如以后法律法规及中国证监会允许基金投资上述品种之外的其他金融工具，本基金可以依照法律法规或监管机构的规定，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 九、基金的投资策略

本基金为增强型指数基金，对指数投资部分，采用完全复制指数的投资策略，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分采取积极配置策略，力争在跟踪误差控制范围内，获取超越基准的业绩表现。

当成份股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购、赎回与转换等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金建仓时间为 3 个月，3 个月之后本基金投资组合比例达到《基金合同》的相关规定。

### 1、资产配置

本基金将不低于 80% 的基金资产投资于创业板指数成份股和备选成份股，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%。基金管理人将综合考虑股票市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。

本基金将根据市场的实际情况，在基金合同规定的范围内适当调整主动投资部分基金资产的配置比例，以争取实现对标的指数的超越。

### 2、股票组合构建

对指数投资部分，本基金主要采取完全复制法进行投资，即按照创业板指数的成份股组成及权重构建股票投资组合。但是当以下情况发生时，基金管理人将对投资组合进行适当调整，以实现本基金对业绩比较基准的紧密跟踪：(1)基金管理人预期指数成份股或权重发生变化；(2)由于市场因素影响、法律法规限制等原因，本基金无法根据指数构建组合；(3)基金发生申购赎回、成份股派发现金股息等可能影响跟踪效果的情形。

对主动投资部分，本基金依托公司投研团队的研究结论，在结合国内外宏观经济状况，充分把握各个行业景气水平和估值水平的基础上，深入挖掘估值偏低或合理，并且成长性良好的股票品种，进行优选配置，

力争获取超额收益。

### 3、股票组合调整

在基金运作过程中，当发生以下情况时，基金管理人将对投资组合进行调整，以降低跟踪误差,实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

(1) 指数编制方法发生变更。基金管理人将评估指数编制方法变更对指数成份股及权重的影响，适时进行投资组合调整。

(2) 指数成份股定期或临时调整。基金管理人将预测指数成份股调整方案，并判断指数成份股调整对投资组合的影响，在此基础上确定组合调整策略。

(3) 指数成份股出现股本变化、增发、配股、派发现金股息等情形。基金管理人将密切关注这些情形对指数的影响，并据此确定相应的投资组合调整策略。

(4) 基金发生申购赎回、参与新股申购等影响跟踪效果的情形。基金管理人将分析这些情形对跟踪效果的影响，据此对投资组合进行相应调整。

(5) 法律法规限制、股票流动性不足、股票停牌等因素导致基金无法根据指数建立组合。基金管理人将根据市场情况，以跟踪误差最小化为原则对投资组合进行调整。

(6) 根据主动增强策略，对增强部分头寸进行主动性的调整，在控制跟踪误差原则下，增强组合收益。

主动增强策略主要为：本基金依托公司投研团队的研究结论，在结合国内外宏观经济状况，充分把握各个行业景气水平和估值水平的基础上，深入挖掘估值偏低或合理，并且基本面和成长性良好的股票品种，进行主动优选配置，力争获取超额收益。同时，在对相关证券发行主体的基本面研究的基础上，综合估值水平、溢价率等指标，本基金将有选择性地参与一级市场上新股、新债的发行或已上市券种的增发，力争获取超额收益。

### 十、基金的业绩比较基准

本基金以创业板指数为标的指数。创业板指数是从创业板股票中选取 100 只组成样本股，反映创业板市场层次的运行情况。创业板指数是深交所多层次资本市场的核心指数之一，由市值较大、成交活跃度高、和最具代表性的 100 家创业板上市企业股票组成，反映创业板市场层次的运行情况。创业板指数样本股中新兴产业、高新技术企业占比高，成长性突出，兼具价值尺度与投资标的的功能。

本基金业绩比较基准为：创业板指数收益率 95%+银行活期存款利率 5%

由于本基金为增强型指数基金，跟踪标的为创业板指数，因此本基金采用上述业绩比较基准。

如果创业板指数被停止编制及发布，或创业板指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致创业板指数不宜继续作为本基金的标的指数，本基金管理人在履行适当程序后，可以变更基金的标的指数和业绩比较基准，并在变更前提前 2 个工作日在中国证监会指定的媒介上公告。

### 十一、基金的风险收益特征

本基金为股票型指数基金，属于高风险高收益的基金品种，其收益和风险均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 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 2018 年 5 月 9 日复核了本报告中的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 2018 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

#### 1.1 报告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 | 582,808,945.64 | 93.27 |
|---|------|----------------|-------|

|  |       |                |       |
|--|-------|----------------|-------|
|  | 其中：股票 | 582,808,945.64 | 93.27 |
|--|-------|----------------|-------|

|   |      |    |  |
|---|------|----|--|
| 2 | 基金投资 | -- |  |
|---|------|----|--|

|   |        |               |      |
|---|--------|---------------|------|
| 3 | 固定收益投资 | 15,003,000.00 | 2.40 |
|---|--------|---------------|------|

|  |       |               |      |
|--|-------|---------------|------|
|  | 其中：债券 | 15,003,000.00 | 2.40 |
|--|-------|---------------|------|

资产支持证券 --  
4 贵金属投资 --  
5 金融衍生品投资 --  
6 买入返售金融资产 --  
其中：买断式回购的买入返售金融资产 --  
7 银行存款和结算备付金合计 20,827,967.79 3.33  
8 其他资产 6,236,673.41 1.00  
9 合计 624,876,586.84 100.00

## 1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 1.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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 37,797,506.46 6.14  
B 采矿业 --  
C 制造业 285,270,818.43 46.36  
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --  
E 建筑业 10,113,954.00 1.64  
F 批发和零售业 --  
G 交通运输、仓储和邮政业 --  
H 住宿和餐饮业 --  
I 信息传输、软件和信息技术服务业 157,278,438.07 25.56  
J 金融业 --  
K 房地产业 --  
L 租赁和商务服务业 5,266,863.84 0.86  
M 科学研究和技术服务业 6,249,099.00 1.02  
N 水利、环境和公共设施管理业 24,905,106.92 4.05  
O 居民服务、修理和其他服务业 --  
P 教育 --  
Q 卫生和社会工作 23,123,252.24 3.76  
R 文化、体育和娱乐业 32,664,384.68 5.31  
S 综合 --  
合计 582,669,423.64 94.69

### 1.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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 --  
B 采掘业 --  
C 制造业 68,658.42 0.01  
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --  
E 建筑业 --  
F 批发和零售业 --  
G 交通运输、仓储和邮政业 36,659.62 0.01  
H 住宿和餐饮业 --  
I 信息传输、软件和信息技术服务业 34,203.96 0.01

J 金融业 --  
 K 房地产业 --  
 L 租赁和商务服务业 --  
 M 科学研究和技术服务业 --  
 N 水利、环境和公共设施管理业 --  
 O 居民服务、修理和其他服务业 --  
 P 教育 --  
 Q 卫生和社会工作 --  
 R 文化、体育和娱乐业 --  
 S 综合 --  
 合计 139,522.00 0.02

### 1.3 报告期末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

#### 1.3.1 报告期末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  | 300498 | 温氏股份 | 1,811,961 | 37,797,506.46 | 6.14         |
| 2  | 300059 | 东方财富 | 1,454,920 | 24,631,795.60 | 4.00         |
| 3  | 300124 | 汇川技术 | 510,328   | 18,045,198.08 | 2.93         |
| 4  | 300003 | 乐普医疗 | 456,228   | 15,384,008.16 | 2.50         |
| 5  | 300136 | 信维通信 | 387,459   | 14,456,095.29 | 2.35         |
| 6  | 300072 | 三聚环保 | 434,205   | 14,068,242.00 | 2.29         |
| 7  | 300070 | 碧水源  | 747,037   | 13,536,310.44 | 2.20         |
| 8  | 300408 | 三环集团 | 539,571   | 13,019,848.23 | 2.12         |
| 9  | 300142 | 沃森生物 | 578,573   | 12,445,105.23 | 2.02         |
| 10 | 300024 | 机器人  | 585,600   | 12,233,184.00 | 1.99         |

#### 1.3.2 报告期末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

| 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  | 300504 | 天邑股份 | 3,062 | 57,596.22 | 0.01         |
| 2  | 002930 | 宏川智慧 | 2,467 | 36,659.62 | 0.01         |
| 3  | 300634 | 彩讯股份 | 2,058 | 34,203.96 | 0.01         |
| 4  | 002931 | 锋龙股份 | 895   | 11,062.20 | 0.00         |

### 1.4 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      | 15,003,000.00 | 2.44         |
| 2  | 央行票据      | --            | --           |
| 3  | 金融债券      | --            | --           |
|    | 其中：政策性金融债 | --            | --           |
| 4  | 企业债券      | --            | --           |
| 5  | 企业短期融资券   | --            | --           |
| 6  | 中期票据      | --            | --           |
| 7  | 可转债（可交换债） | --            | --           |
| 8  | 同业存单      | --            | --           |

9 其他 --

10 合计 15,003,000.00 2.44

1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 | 01956317 | 国债 09150,000 | 15,003,000.00 | 2.44 |  |
|---|----------|--------------|---------------|------|--|

1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

1.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

1.11 投资组合报告附注

1.11.1 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。

1.11.2 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。

1.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|----|-------|
|----|----|-------|

|   |       |           |
|---|-------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 53,331.59 |
|---|-------|-----------|

|   |         |              |
|---|---------|--------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 2,007,033.23 |
|---|---------|--------------|

|   |      |   |
|---|------|---|
| 3 | 应收股利 | - |
|---|------|---|

|   |      |            |
|---|------|------------|
| 4 | 应收利息 | 457,071.05 |
|---|------|------------|

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 5 | 应收申购款 | 3,664,947.26 |
|---|-------|--------------|

|   |       |           |
|---|-------|-----------|
| 6 | 其他应收款 | 54,290.28 |
|---|-------|-----------|

|   |      |   |
|---|------|---|
| 7 | 待摊费用 | - |
|---|------|---|

|   |    |   |
|---|----|---|
| 8 | 其他 | - |
|---|----|---|

|   |    |              |
|---|----|--------------|
| 9 | 合计 | 6,236,673.41 |
|---|----|--------------|

1.11.4 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。

1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 1.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

#### 1.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1 002931 锋龙股份 11,062.20 0.00 新股锁定

### 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。

本基金合同生效日为2012年4月6日，业绩表现截止日为2017年12月31日。自基金合同生效以来，本基金基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较如下：

#### 融通创业板指数 A/B

| 阶段                              | 份额净值增长率 | 份额净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | —       | —      |
|---------------------------------|---------|------------|-----------|--------------|---------|--------|
| 2012年4月6日(基金合同生效日)起至2012年12月31日 | -2.78%  | 1.24%      | 2.31%     | 1.42%        | -5.09%  | -0.18% |
| 2013年度                          | 75.62%  | 1.94%      | 77.74%    | 1.89%        | -2.12%  | 0.05%  |
| 2014年度                          | 7.80%   | 1.49%      | 12.33%    | 1.50%        | -4.53%  | -0.01% |
| 2015年度                          | 70.26%  | 3.24%      | 85.83%    | 3.03%        | -15.57% | 0.21%  |
| 2016年度                          | -25.93% | 2.17%      | -21.44%   | 2.03%        | -4.49%  | 0.14%  |
| 2017年度                          | -15.60% | 1.00%      | -10.09%   | 0.99%        | -5.51%  | 0.01%  |

#### 融通创业板指数 C

| 阶段                     | 份额净值增长率 | 份额净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益率 | 业绩比较基准收益率标准差 | —      | —      |
|------------------------|---------|------------|-----------|--------------|--------|--------|
| 2017年7月5日起至2017年12月31日 | -8.73%  | 1.06%      | -4.30%    | 1.07%        | -4.43% | -0.01% |

注：本基金于2017年7月5日起新增C类份额。

### 十四、费用概览

#### (一) 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、C类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

#### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \times \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值



基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \times \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%，销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.4\% \times \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给登记机构，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

基金销售服务费用于基金的销售与基金份额持有人的服务等。

上述（一）基金费用的种类中第 4~9 项费用，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。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调整基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金销售费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒介和基金管理人网站上公告。

### （五）与基金销售有关的费用

#### （1）申购费率

前端申购费率：

本基金 C 类基金份额不收取前端申购费。本基金 A 类基金份额对通过基金管理人的直销柜台申购的养老金客户与除此之外的非养老金客户实施差别的申购费率。

上述养老金客户包括基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老金等，具体包括：

- 1) 全国社会保障基金；
- 2) 可以投资基金的地方社会保障基金；
- 3) 企业年金单一计划以及集合计划；

4) 企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司将在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。

1) 通过基金管理人的直销柜台申购的养老金客户的申购费为每笔 100 元。

2) 非养老金客户的申购费率如下：

申购金额 (M) 前端申购费率

$M < 100$  万 1.20%

$100$  万  $\leq M < 500$  万 0.80%

$M \geq 500$  万 单笔 1000 元

本基金 B 类基金份额的申购费率 (后端申购费率)：

持有时间 (T) 后端申购费率

$T < 1$  年 1.50%

$1$  年  $\leq T < 2$  年 1.12%

$2$  年  $\leq T < 3$  年 0.75%

$3$  年  $\leq T < 4$  年 0.37%

$T \geq 4$  年 0

基金份额每多持有一年，其后端申购费率按 25% 递减，最低为零，精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去。

注：上表中，1 年以 365 天计算。

(2) 本基金 A/B 类基金份额的赎回费率

本基金的赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，同时区分普通客户赎回和通过直销柜台赎回的养老金客户。

上述养老金客户包括基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老金等，包括：

1) 全国社会保障基金；

2) 可以投资基金的地方社会保障基金；

3) 企业年金单一计划以及集合计划；

4) 企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人届时将发布临时公告将其纳入养老金客户范围，在招募说明书更新时对其进行更新，并按规定向中国证监会备案。

普通客户指除通过直销柜台赎回的养老金客户以外的其他客户。

普通客户赎回的具体费率如下：

持有时间 (T) 赎回费率

$T < 7$  日 1.5%

$7$  日  $\leq T < 1$  年 0.50%

$1$  年  $\leq T < 2$  年 0.25%

$T \geq 2$  年 0

注：上表中，1 年以 365 天计算。

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。

对于普通客户而言，对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人，收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于 7 日的基金份额持有人，其赎回费总金额的 25% 归基金财产所有，其余部分用于支付注册登

记费和其他必要的手续费。

对于养老金客户而言，对持续持有期少于7日的基金份额持有人，赎回费率为1.5%，收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于7日基金份额持有人设置特定赎回费率，特定赎回费率为原赎回费率的25%，收取的特定赎回费全额计入基金财产。

#### （3）本基金C类基金份额的赎回费率

持有时间（T） 赎回费率

T<7日 1.50%

7日≤T<30天 0.50%

T≥30天 0

本基金C类基金份额赎回费全部归基金财产所有。

#### （4）转换费率

1)基金转换费用包括转换费和补差费；

2)转换费：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。

3)补差费：转出基金的申购费率（或认购费率）高于转入基金的申购费率（或认购费率）时，补差费为0；转出基金的申购费率（或认购费率）低于转入基金的申购费率（或认购费率）时，按申购费率（或认购费率）的差额收取补差费；

4)基金补差费的收取以该基金份额曾经有过的最高申（认）购费率为基础计算，累计不超过最高认购（申购）费率与最低认购（申购）费率的差额；

5)基金转换费由转换申请人承担，其中25%归转出基金的基金财产（但对持续持有期少于7日的客户收取的赎回费全额计入基金财产），基金转换费用的其余费用作为市场推广、注册登记费和其他手续费；

目前参与本基金的转换业务的其他开放式基金的费率详见各相关基金最新招募说明书或公告的约定。

基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购、赎回与转换费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施日前2个工作日在至少一家指定媒介及基金管理人网站上刊登公告。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金申购、赎回与转换费率。

#### （六）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### 十五、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2017年11月17日刊登的本基金更新招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、在二、释义中增加了流动性风险管理规定和流动性受限资产的说明；
- 2、在三、基金管理人部分，对（一）基金管理人概况和（二）主要人员情况进行了更新；
- 3、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；
- 4、在五相关服务机构部分，更新了直销机构、代销机构和注册登记机构的相关信息；
- 5、在八、基金份额的申购、赎回和转换部分，根据最新规则对（六）申购、赎回与转换的数额和价格、（七）申购、赎回与转换的注册登记、（八）拒绝或暂停申购的情形及处理方式、（九）暂停赎回或延续支付赎回款项的情形及处理方式和（十一）巨额赎回的情形及处理方式进行了更新；
- 6、在九、基金的投资部分，更新了（十一）基金投资组合报告的内容，更新数据为本基金2018年1季度报告中的投资组合数据；
- 7、更新了十、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；

- 8、对十四、基金费用与税收部分的内容进行了更新；
- 9、对二十一、对基金份额持有人的服务部分的内容进行了更新；
- 10、在二十二、其他应披露的事项部分，对本报告期内的基金公告进行了列表说明。

融通基金管理有限公司

2018年5月19日