融通深证成份指数证券投资基金更新招募说明书摘要（2014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○一四年六月

重要提示

本基金经中国证监会2010年5月6日证监许可[2010]606号文核准。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，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。

投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读本更新招募说明书。

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更新招募说明书编写，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》、《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。

本招募说明书所载内容截止日为2014年5月15日，有关财务数据截止日为2014年3月31日，本招募说明书中的财务数据未经审计。

一、基金合同生效日期

2010年11月15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，现任融通基金管理有限公司董事长。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；新时代证券有限责任公司总经理。2010年3月至今，任公司董事长。

独立董事杜婕女士，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、执业律师。现任南开大学金融学教授（博士生导师）、金融发展研究院副院长（主持工作）。曾经就读伦敦大学伦敦商学院，执教于密歇根大学WDI研究所、北京大学光华管理学院、长江商学院。2011年1月至今，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。

董事马金声先生，高级经济师。现任新时代证券有限责任公司名誉董事长。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。现任融通基金管理有限公司总经理。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1月至今，任公司董事。

董事Frederick Reidenbach (弗莱德)先生，毕业于美国宾夕法尼亚州斯克兰顿大学，注册会计师。现任日兴资产管理有限公司执行副总裁兼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 Service的首席财务官和首席营运官。2010年3月至今，任公司董事。

董事Blair Pickerell（裴布雷）先生，工商管理硕士。现任日兴资产管理香港有限公司亚洲区总裁及全球首席营销总监。历任摩根士丹利亚洲有限公司董事总经理。2012年1月至今，任公司董事。

董事涂卫东先生，法学硕士。现任融通基金管理有限公司督察长。历任国务院法制办公室(原国务院法制局)财金司一处主任科员；中国证监会基金监管部监管一处处级干部；中国证监会公职律师。2009年4月至今，任中共融通基金管理有限公司支部委员会副书记。2010年3月至今，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)财金司一处主任科员；中国证监会基金监管部监管一处处级干部；中国证监会公职律师。2009年4月至今，任中共融通基金管理有限公司支部委员会副书记。2011 年至今任公司督察长。

4、基金经理

（1）现任基金经理情况

王建强先生，本科学历，具有证券从业资格，10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，现担任融通深证100指数基金、融通巨潮100 指数（LOF）基金、融通创业板指数基金的基金经理。

李勇先生，研究生学历，具有证券从业资格，9年证券从业经验。2005 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，现同时担任融通创业板指数基金经理。

（2）历任基金经理情况

自2010年11月15日至今，由王建强先生和李勇先生共同担任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

公司投资决策委员会由总经理奚星华先生，常务副总经理颜锡廉（Allen Yan）先生，总经理助理陈鹤明（曾用名陈晓生）先生，基金管理部总监吴巍先生，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、基金托管人概况

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2014年3月末，中国工商银行资产托管部共有员工175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2014年3月，中国工商银行共托管证券投资基金372只。自2003 年以来，本行连续十年获得香港《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41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机构理财部机构销售及服务深圳小组
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：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机构理财部机构销售及服务北京小组
办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座1241－1243单元
邮政编码：100140
联系人：宋雅萍
电话：（010）66190975

（3）融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及服务上海小组
办公地址：上海市世纪大道8号国金中心汇丰银行大楼6楼601－602
邮政编码：200120
联系人：居雯莉
联系电话：（021）38424888－4984

（4）融通基金管理有限公司网上直销
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：刘晶
联系电话：（0755）26948105

2、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
电话：（010）66107900
联系人：杨菲

(2)中国建设银行
注册地址：北京市西城区金融大街25号
法定代表人：王洪章
电话：（010）66275654
联系人：王琳

(3)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
客户服务电话：95566

(4)交通银行
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：胡怀邦
电话：（021）58781234
联系人：张作伟

(5)民生银行
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2 号
法定代表人：董文标
客服电话：95568
联系人：董云巍

(6)渤海银行
注册地址：天津市河西区马场道201－205号
办公地址：天津市河西区马场道201－205号
法定代表人：刘宝凤
电话：（022）58316666
联系人：王宏

(7)中信银行
注册地址：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址：北京东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人：田国立
电话：（010）65557083
联系人：丰靖

(8)北京银行
注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址：北京市西城区金融大街甲17号
法定代表人：闫冰竹
电话：（010）66223584
联系人：王曦

(9)上海银行
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：范一飞
电话：（021）68475888
联系人：夏雪

(10)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：曾小普
联系人：周欣玲
电话：（0791）86281305
客服电话：4008222111

(11)上海证券有限责任公司
注册地址：上海市黄浦区西藏路336号
法定代表人：龚德雄
联系人：王伟力
电话：（021）68475888
客服电话：4008918918

(12)海通证券股份有限公司
注册地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
联系人：李笑鸣
电话：（021）23219275
客服电话：4008888001

(13)光大证券股份有限公司
注册地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：薛峰
联系人：刘晨
电话：（021）22169081
客服电话：95525

(14)长江证券股份有限公司
注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
联系人：李良
电话：（027）68751929
客服电话：4008888999

(15)中信建投证券股份有限公司
注册地址：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：许梦园
电话：（010）85130236
客服电话：95587

(16)民生证券股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16－18层
法定代表人：余政
联系人：赵明
电话：（010）85252656
客服电话：4006198888

(17)中信万通证券有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层
法定代表人：杨宝林
联系人：吴忠超
电话：（0532）85022326
客服电话：96577

(18)宏源证券股份有限公司
注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦
法定代表人：冯戎
联系人：李巍
电话：（010）88085858
客服电话：4008000562

(19)华安证券股份有限公司
注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
法定代表人：李工
联系人：钱欢
电话：（0551）65161821
客服电话：96518

(20)新时代证券有限责任公司
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：刘汝军
联络人：孙恺
电话：（010）83561149
客服电话：4006989898

(21)国都证券有限责任公司
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：贾婧
联系电话：（010）84183122
电话：4008188118

(22)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号国际企业大厦C座2－6层
法定代表人：陈有安
联系人：田薇
电话：（010）66568430
客服电话：4008－888－8888

(23)国元证券股份有限公司
注册地址：安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人：蔡咏
联系人：杨鹏军
电话：（0551）2207966
客服电话：95578

(24)国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
法定代表人：万建华
联系人：芮敏祺
传真：（021）62580818
客服电话：4008888666

(25)申银万国证券股份有限公司
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：储晓明
联系人：曹晔
电话：（021）33388215
客服电话：4008895523

(26)东吴证券股份有限公司
注册地址：苏州市工业园区星阳路5号
法定代表人：范力
联系人：方晓丹
电话：（0512）65581136
客服电话：4008601555

(27)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：宫少林
联系人：邱晓星
电话：（0755）83285134
客服电话：95565

(28)长城证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
联系人：刘阳
电话：（0755）83516289
客服电话：4006666888

(29)金元证券股份有限公司
注册地址：海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
法定代表人：陆涛
联系人：张霞
电话：（0755）21516897
客服电话：4008888228

(30)平安证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人：杨宇翔
联系人：郑舒丽
电话：（0755）22626391
客服电话：95511转8

(31)安信证券股份有限公司
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
法定代表人：牛冠兴
联系人：郑向溢
电话：（0755）82558038
客服电话：4008001001

(32)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
法人代表：刘学民
联系人：毛诗莉
电话：（0755）25831754
客服电话：4008881888

(33)华龙证券有限责任公司
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

(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：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
联系人：林爽
联系电话：010－66045608
客服电话：010－66045678

(35)恒泰证券股份有限公司
注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人：庞介民
联系人：魏巍
电话：（0471）4974437
客服电话：（0471）4961259

(36)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：鹿馨方
电话：（010）63080994
客服电话：4008008899

(37)华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦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

(38)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全层
法定代表人：张建军
联系人：王鑫
电话：（020）38286651
客服电话：4008888133

（39）中国邮政储蓄银行（仅代销前端）
注册地址：北京市西城区宣武门内大街131号
法定代表人：刘安东
电话：95580

（40）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：腾艳
电话：（010）60838832
客服电话：4008895548

（41）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：杜庆平
联系人：胡天彤
电话：（022）28451709
客服电话：4006515988

（42）恒泰长财证券有限责任公司
注册地址：吉林省长春市长江路经济开发区人民大街280号科技城2层A－33段
法定代表人：赵培武
联系人：王楠
电话：（0431）86702865
客服电话：（0431）82951765

（43）中信证券（浙江）有限责任公司
注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人：沈强
联系人：李珊
电话：（0571）85776114
客服电话：95548

（44）中国农业银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街69号
办公地址：北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人：蒋超良
联系人：高阳
客户服务电话：95599

（45）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
办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室
法定代表人：汪静波
联系人：贾雅楠
电话：021－38509630
客服电话：400－821－5399

（46）深圳众禄基金销售有限公司
注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755－33227950

（47）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3号楼C座9楼
法定代表人：其实
联系人：练兰兰
电话：021－54509998
客服电话：400－1818188

（48）上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室
法定代表人：杨文斌
联系人：蒋章
电话：021－58870011
客服电话：400－700－9665

（49）杭州数米基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人：陈柏青
联系人：周嬿旻
电话：0571－28829790，021－60897869
客服电话：4000－766－123

（50）上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
法定代表人：张跃伟
电话：021－58788678
联系人：吕慧

（51）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
联系人：李延鹏
客服热线：400－920－0022、021－20835588

（52）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
联系人：王婉秋
电话：010－62020088
传真：010－62020355
客服电话：400－888－6661

（53）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：卓紘晶
联系人：王娓萍
电话：0755－33376853
传真：0755－33065516
客服电话：4006－877－899

（54）中期时代基金销售（北京）有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路16 号1 幢11 层
法人代表：路瑶
电话：400－8888－160
传真：010－59539866
联系人：朱剑林
客服电话：95162、4008888160

（55）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
联系人：孙晋峰
电话：010－67000988
传真：010－67000988－6000
客户服务电话：400－001－8811

（56）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：北京市阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人：吴雪秀
联系人：段京璐
电话：010－88312599
传真：010－88312099
客户服务电话：400－001－1566
网址：www.yilucaifu.com

（57）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
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
电话：0571－88911818
传真：0571－86800423
客户服务电话：4008－773－772

（58）嘉实财富管理有限公司
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

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

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：田德军
电话：0755－26948075
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

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：汪棣、刘莉
经办注册会计师：汪棣、王灵

五、基金的名称

融通深证成份指数证券投资基金

六、基金的类型

契约型开放式

七、基金的投资目标

本基金采取完全复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内，以实现对深证成份指数的有效跟踪。

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，包括标的指数的成份股与备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。投资于指数成份股与备选成份股的资产不低于股票资产的90%，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

本基金为被动式指数基金，原则上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，力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在0.35%以内、年化跟踪误差控制在4%的投资目标。

当成份股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回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已达到《基金合同》的相关规定。

1、资产配置

本基金采用自上而下的两层资产配置策略，首先确定基金资产在股票、现金和其它金融工具之间的配置比例，再进一步以完全复制基准指数的方法，确定组合中各股票的配置比例。本基金追求对股票的充分投资，本基金股票资产占基金资产的比例为90%－95%，其中投资深证成份指数成份股及其备选成份股的资产不低于股票资产的90%。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。在巨额申购赎回发生、成份股大比例分红等情况下，管理人将在综合考虑冲击成本因素和跟踪效果后，及时将股票配置比例调整至合理水平。

本基金力争将年化跟踪误差控制在4%以内，日跟踪偏离度绝对值的平均值控制在0.35%以内。

2、股票组合构建

本基金主要采取完全复制法进行投资，即按照深证成份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。

待指数衍生金融产品推出以后，本基金可以运用衍生金融产品进一步降低跟踪误差。

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。

十、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：深证成份指数收益率 × 95% ＋ 银行活期存款利率 × 5%

由于本基金为完全复制型指数基金，跟踪标的为深证成份指数，因此本基金采用上述业绩比较基准。

深证成份指数，是从深交所上市的所有股票中抽取具有市场代表性的40家上市公司的股票作为计算对象，并以流通股为权数计算得出的加权股价指数，综合反映深交所上市股票的股价走势。深证成份指数的成份股为市场中市场代表性好，流动性好，交易活跃的主流投资股票，能够反映市场主流投资的收益情况。

如果深证成份指数被停止编制及发布，或深证成份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深证成份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体上公告。

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2014年6月10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2014年3月31日。本报告中所列财务数据未经审计。

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	501,176,581.61	94.03
	其中：股票	501,176,581.61	94.03
2	固定收益投资	－	－
	其中：债券	－	－
	资产支持证券	－	－
3	贵金属投资	－	－
4	金融衍生品投资	－	－
5	买入返售金融资产	－	－
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	－
6	银行存款和结算备付金合计	29,149,037.67	5.47
7	其他资产	2,697,195.96	0.51
8	合计	533,022,815.24	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	采矿业	12,835,658.25	2.42
C	制造业	307,742,626.91	57.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	－	－
E	建筑业	6,586,886.64	1.24
F	批发和零售业	19,248,383.70	3.63
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	－	－
J	金融业	71,957,484.83	13.56
K	房地产业	62,824,380.77	11.84
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	19,981,160.51	3.77
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	501,176,581.61	94.44

（2）报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末无积极投资部分股票。

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

（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	000002	万　科A	5,675,091	45,911,486.19	8.65
2	000651	格力电器	1,535,721	43,000,188.00	8.10
3	000001	平安银行	2,751,885	29,637,801.45	5.58
4	000333	美的集团	482,830	21,765,976.40	4.10
5	000858	五 粮 液	1,184,445	19,744,698.15	3.72
6	002024	苏宁云商	2,741,935	19,248,383.70	3.63
7	000776	广发证券	1,925,700	19,025,916.00	3.59
8	000895	双汇发展	417,548	16,405,460.92	3.09
9	000538	云南白药	182,528	15,332,352.00	2.89
10	000063	中兴通讯	1,207,554	15,263,482.56	2.88

（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

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

8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。

9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（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。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

（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。

（3）本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

11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）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	27,783.62
2	应收证券清算款	2,626,722.83
3	应收股利	－
4	应收利息	5,589.86
5	应收申购款	37,099.65
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	2,697,195.96

（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）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

（i）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。

（ii）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

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。

本基金合同生效日为2010年11月15日，基金业绩截止日为2014年3月31日。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：

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
2010年11月15日至2010年12月31日	0.90%	0.99%	－1.98%	1.62%	2.88%	－0.63%
2011年度	－27.55%	1.30%	－27.11%	1.31%	－0.44%	－0.01%
2012年度	3.15%	1.36%	2.25%	1.36%	0.90%	0.00%
2013年度	－10.08%	1.39%	－10.27%	1.37%	0.19%	0.02%

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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、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 × 1.00% ÷ 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 × 0.20% ÷ 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。

上述一、基金费用的种类中第3—8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。

调高基金管理费率、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；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，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体和基金管理人网站上公告。

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2013年12月26日刊登的本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1、在“三、基金管理人”部分，对“（二）主要人员情况”和“（七）基金管理人的内部控制制度”进行了更新；

2、在“四、基金托管人”部分，对基金托管人的主要人员情况和相关业务经营情况及基金托管人的内部控制制度按照最新资料进行了更新；

3、在“五、相关服务机构”部分，更新了直销机构和代销机构的相关信息和会计师事务所信息；

4、在“八、基金份额的申购、赎回与转换”部分，更新了“（六）申购、赎回与转换的数额和限制”的内容；

5、在“九、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2014年第1季度报告中的投资组合数据；

6、在“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；

7、更新了“二十一、对基金份额持有人的服务”部分的内容；

8、在“二十二、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
二〇一四年六月二十七日