融通巨潮100指数证券投资基金（LOF）更新招募说明书摘要

(2017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：二〇一七年六月

重要提示

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。本基金的基金合同生效日为2005年5月12日。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，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。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。

本招募说明书所载内容截止日为2017年5月11日，有关财务数据截止日为2017年3月31日，净值表现截止日为2016年12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
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（Nikko Asset Management Co.,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。

董事马金声先生，高级经济师，现任新时代证券股份有限公司名誉董事长。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1月至今，任公司董事。

董事黄庆华先生，工科学士，现任上海宜利实业有限公司总裁助理兼投资管理部总经理。历任上海宜利实业有限公司投资管理部经理助理、新时代证券股份有限公司经纪事业部综合管理处主管。2015年2月至今，任公司董事。

董事David Semaya（薛迈雅）先生，教育学硕士，现任日兴资产管理有限公司执行董事长，三井住友信托银行有限公司顾问。历任日本美林副总，纽约美林总监，美林投资管理有限公司首席运营官、代表董事和副总、代表董事和主席，巴克莱全球投资者日本信托银行有限公司总裁及首席执行官，巴克莱全球投资者(英国)首席执行官，巴克莱集团、财富管理(英国)董事及总经理。2015年6月至今，任公司董事。

董事Allen Yan（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Allen Yan（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），5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2005年5月12日至2009年5月14日，由张野先生担任本基金的基金经理。

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

自2010年4月17日至2015年1月8日，由王建强先生担任本基金的基金经理。

自2015年1月9日至2015年2月10日，由李勇先生担任本基金的基金经理。

自2015年2月11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：投资总监商小虎先生，权益投资负责人、基金经理邹曦先生，研究部副总监、基金经理余志勇先生，研究部总监助理、基金经理付伟琦先生，基金经理张延闽先生。

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3月末，中国工商银行资产托管部共有员工205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。

（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3月，中国工商银行共托管证券投资基金709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53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、直销机构情况

（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：魏艳薇
电话：（010）66190989

（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：刘佳佳
联系电话：（021）38424889

（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：殷洁
联系电话：（0755）26947856

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）中国工商银行股份有限公司
注册地址：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
电话：（010）66107900
客户服务电话：95588

（2）交通银行股份有限公司
注册地址：上海市银城中路188号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
联系人：曹榕
电话：021—58781234
传真：021—58408483
客户服务电话：95559

（3）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：周慕冰
客户服务电话：95599

（4）招商银行股份有限公司
注册地址：深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人：李建红
联系人：邓炯鹏
电话：（0755）83198888
客户服务电话：95555

（5）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：王洪章
联系人：王琳
客服电话：95533

(6) 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富华大厦C座
法定代表人：常振明
电话：（010）65541405

(7) 中国银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人：田国立
客服电话:95566

(8) 中国民生银行股份有限公司
注册地址：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
电话：010-57092615
客服电话：95568

(9) 中国光大银行股份有限公司
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）63636153
联系人：朱红
客户服务电话：95595

(10) 平安银行股份有限公司
注册办公所：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
法定代表人：谢永林
联系人：张莉
电话：021-38637673
客户服务电话：95511-3

（11）中国邮政储蓄银行股份有限公司
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

（12）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

(13) 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：汤征程
开放式基金咨询电话：021-962888
网址：www.bankofshanghai.com

（14）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 邮编：100032
办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层 邮编：100033
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

（15）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋
法定代表人：汪静波
电话：021-38509735
传真：021-38509777
联系人：李娟
客服热线：400-821-5399
公司网站：www.noah-fund.com

（16）深圳众禄金融控股股份有限公司
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

（17）上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
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：高莉莉
电话：（021）54509998
客服电话：400-181-8188

（18）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

（19）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
办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人：张跃伟
联系人：敖玲
电话：021-58788678-8201
传真：021—58787698
客服电话：400-089-1289
公司网站：www.erichfund.com

（20）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

(21) 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
法人代表：闫振杰
电话：010-62020088
传真：010-62020355
联系人：王婉秋
客服电话：400-888-6661

(22) 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

(23) 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

（24）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

(25) 深圳富济财富管理有限公司
办公地址：深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室
法定代表人：齐小贺
电话：0755-83999907
联系人：马力佳
公司网站：www.jinqianwo.cn

(26) 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

(27) 北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
法定代表人：赵荣春
客服电话：400-893-6885

(28)深圳富济财富管理有限公司
办公地址：深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室
法定代表人：齐小贺
电话：0755-83999907
联系人：马力佳

（29）上海陆金所资产管理有限公司（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

（30）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

（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）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
客户服务电话：400-619-9059
网址：www.hcjijin.com

（33）厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
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
电话：0592-3122757
传真：0592-3122701
客户服务电话：400-918-0808
公司网站：www.xds.com.cn

（34）一路财富（北京）信息科技有限公司
注册地址：北京市西城区阜成门大街2号1幢A2008室
办公地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人：吴雪秀
联系人：刘栋栋
电话：010-88312877
传真：010-88312099
客户服务电话：400-001-1566
网址：www.yilucaifu.com

（35）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/

（36）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

（37）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（入住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：TAN YIK KUAN
电话：0755-8946 0500
传真：0755-2167 4453
联系人：叶健
客服热线：400-684-0500
公司网站：www.ifastps.com.cn

（38）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

(39)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：朱雅崴
传真：（021）62580818
客服电话：4008888666

(40) 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：辛国政
电话：（010）83575407
客服电话：4008-888-8888

(41)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：涂洋
电话：（021）23219275
服务热线：400-8888-001

(42)广发证券股份有限公司
注册地址：广州市天河区天河北路183号大都会广场43楼
法定代表人：孙树明
联系人：黄岚
电话：（020）87555888转833
客户服务热线：95575

(43)国信证券股份有限公司
注册地址: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：李颖
电话：(0755)82130833
客服电话：95536

(44)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：许梦园
电话：（010）85130236 客服电话：95587

(45)东方证券股份有限公司
注册地址：上海市中山南路318号2号楼22、23、25-29层
法定代表人：潘鑫军
联系人：吴宇
电话：（021）63325888
客服电话：95503

(46)国元证券股份有限公司
注册地址：合肥市寿春路179号
法定代表人：蔡咏
联系人：杨鹏军
电话：（0551）2207114
客服电话：95578，4008888777

(47)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：韩秀萍
电话：（010）85127999
客服电话：4006198888

(48)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：吴万善
联系人：庞晓芸
电话：（0755）82492193
客户服务电话：95597

(49)兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号证券大厦
法定代表人：兰荣
联系人：夏中苏
电话：（0591）38281963
客服电话：95562

(50)平安证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田中心区金田路荣超大厦4036号16-20层
法定代表人：谢永林
联系人：周一涵
电话：（021）38637436
客服电话：95511转8

(51)长江证券股份有限公司
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
联系人：奚博宇
电话：（021）68751860
客服热线：4008-888-999，95579

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

(53)长城证券股份有限公司
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：黄耀华
联系人：李嘉禾
电话：（0755）83516289
客服电话：4006666888

(54)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：范超
电话：（0551）65161821
客服电话：95318，4008096518

(55)华西证券股份有限公司
注册地址：四川省成都市高新区天府二街198号
法定代表人：杨炯洋
联系人：谢国梅
电话：010-52723273
客服电话：4008888818

(56) 申万宏源证券股份有限公司
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：李梅
电话：（021）33389888
联系人：李玉婷
客服热线：95523或4008895523

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

(58)南京证券股份有限公司
注册地址：江苏省南京市大钟亭8号
法定代表人：步国旬
联系人：徐翔
电话：（025）83367888
客服电话：4008285888

(59)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：马跃进
联系人：周欣玲
电话：（0791）86283080
客服电话：400822211

(60)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：李晓皙
电话：（021）22169081
客服电话：95525

(61)国联证券股份有限公司
注册地址：无锡市金融一街8号
法定代表人：姚志勇
联系人：袁丽萍
电话：（0510）82831662
客服电话：（0510）2588168

(62)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：田德军
联系人：田芳芳
电话：（010）83561146
客服热线：400-6989-898

(63)世纪证券有限责任公司
注册地址：深圳市深南大道招商银行大厦40-42层
法定代表人：卢长才
联系人：袁媛
电话：（0755）83199599-8166
客服电话：4008-323-000

(64)招商证券股份有限公司
注册地址：深圳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：黄婵君
电话：（0755）82960167
客服电话：95565

(65)东北证券股份有限公司
注册地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：李福春
联系人：安岩岩
电话：（0431）85096517
客户服务电话：4006000686

(66)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
法定代表人：刘学民
联系人：李若晨
电话：（0755）25831754
客服电话：4008881888

(67)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：张雅锋
联系人：武斌
联系电话：（0755）83707413
客服电话：95563

(68)东莞证券有限责任公司
注册地址：东莞市莞城区可园南路1号
法定代表人：张运勇
联系人：梁健伟
电话：（0769）22119462
客户服务电话：（0769）961130

(69)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：王少华
联系人：黄静
电话：（010）84183389
客服电话：400818811

(70)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

(71) 申万宏源西部证券有限公司
注册地址：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：李季
联系人：李巍
电话：010-88085858

(72)华林证券股份有限公司
联系地址：深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
法定代表人：宋志江
联系人：杨琳
电话：（0755）82707855
客服电话：4001883888

(73)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：4006898888

(74) 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
法定代表人：杨宝林
联系人：孙秋月
电话：（0532）85023924
客服电话：95548

(75)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
法人代表人：王连志
联系人：郑向溢
电话：（0755）82558038
客服热线：4008001001

(76)西部证券股份有限公司
注册地址：西安市东新街232号信托大厦16-17层
法定代表人：刘建武
联系人：梁承华
电话：（029）87406649
客服电话：95582

(77)方正证券股份有限公司
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：刘丹
联系电话：（0731）85832463
客服电话：95571

（78）上海证券有限责任公司
注册地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼
法定代表人：李俊杰
联系人：王伟力
电话：（021）68475888
客服电话：4008918918

（79）信达证券股份有限公司
注册地址：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
联系人：尹旭航
电话：（010）63080994
客服电话：4008008899

（80）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至10层
法定代表人：黄金琳
联系人：张腾
电话：（0591）87383623
客服电话：0591-96326

（81）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：周雪晴
电话：（010）60838995
客服电话：4008895548

（82）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：魏巍
电话：（0471）4974437
客服电话：（0471）4961259

（83）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：马焱
电话：010-88321613
客服电话：4006-650-999

（84）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
电话：021-20315290
联系人：许曼华
客服电话：95538

（85）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
电话：023-63786141
联系人：周青
客服电话：4008096096

（86）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
电话：010-85679888-6035
联系人：秦朗
客服电话：4009101166

（87）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

（88）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
电话：0755-82791065
联系人：韩钰
客服热线：4009908826

（89）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

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

（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二层西201、202室
办公地址：深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场二层西201、202室
法定代表人：闵齐双
联系人：崔卫群
经办律师：闵齐双? 崔卫群　鲍泽飞
电话：075532981061（直线）? 075532981099（直线） 18923401598
传真：075533033086

（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）
住所：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?
联系电话：（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

融通巨潮100指数证券投资基金（LOF）

六、基金的类型

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，在数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；风险管理部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）基金经理根据风险管理部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）风险管理部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门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，基金经理根据投资委员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）固定收益部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）固定收益部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基金合同规定，于2017年6月7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2017年3月31日。

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	771,939,267.02	94.66
	其中：股票	771,939,267.02	94.66
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	29,910,000.00	3.67
	其中：债券	29,910,000.00	3.67
	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	12,976,045.47	1.59
8	其他资产	663,135.81	0.08
9	合计	815,488,448.30	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 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	7,896,520.88	0.97
B	采矿业	27,976,060.07	3.45
C	制造业	174,300,104.30	21.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,570,996.50	0.81
E	建筑业	40,405,508.05	4.98
F	批发和零售业	510,840.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	29,788.56	0.00
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	36,350,286.28	4.48
J	金融业	382,986,800.99	47.17
K	房地产业	29,106,471.44	3.59
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	18,934.20	0.00
S	综合	–	–
	合计	706,152,311.27	86.98

2.2 报告期末积极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	1,304,100.00	0.16
B	采矿业	14,412,775.00	1.78
C	制造业	37,238,907.44	4.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,090.00	0.00
E	建筑业	212,432.50	0.03
F	批发和零售业	132,295.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	8,460,173.89	1.04
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,841,581.20	0.47
J	金融业	29,968.70	0.00
K	房地产业	9,944.00	0.00
L	租赁和商务服务业	28,518.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	46,724.92	0.01
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	37,514.94	0.00
S	综合	–	–
	合计	65,786,955.75	8.10

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

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	601318	中国平安	1,476,434	54,642,822.34	6.73
2	601166	兴业银行	2,347,231	38,048,614.51	4.69
3	601668	中国建筑	3,752,063	34,518,979.60	4.25
4	000651	格力电器	1,048,574	33,239,795.80	4.09
5	600837	海通证券	2,030,378	29,643,518.80	3.65
6	601211	国泰君安	1,510,529	27,567,154.25	3.40
7	000001	平安银行	2,993,887	27,453,943.79	3.38
8	600048	保利地产	2,840,008	27,065,276.24	3.33
9	600015	华夏银行	2,234,265	25,224,851.85	3.11
10	601988	中国银行	6,781,426	25,091,276.20	3.09

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	601608	中信重工	3,415,800	19,811,640.00	2.44
2	603993	洛阳钼业	2,169,000	10,215,990.00	1.26
3	600150	中国船舶	295,757	8,369,923.10	1.03
4	601919	中远海控	1,406,900	8,314,779.00	1.02
5	000983	西山煤电	434,900	4,196,785.00	0.52

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	29,910,000.00	3.68
	其中：政策性金融债	29,910,000.00	3.68
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	29,910,000.00	3.68

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	170401	17农发01	300,000	29,910,000.00	3.68

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

本基金本报告期末投资股指期货。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

（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

本基金本报告期末投资国债期货。

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、处罚的情形。

海通证券：2016年11月28日，海通证券收到中国证监会《行政处罚决定书》（[2016]127号）。中国证监会根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定对海通证券责令改正并给予警告，没收违法所得28,653,000元，并处以85,959,000元罚款。

针对此案，海通证券公告已按照监管要求完成了整改；同时，公司对涉及此案所得和处罚金额已于2015年度全额计入损益，因此，本次《行政处罚决定书》对公司2016年及未来财务无重大影响。

本基金依照法律法规及基金合同的约定，采取指数化投资策略，紧密跟踪标的指数。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。同时，本基金管理人将继续对上述公司进行跟踪研究。

（2）本基金投资的前十名股票未超出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	149,053.70
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	226,881.50
5	应收申购款	287,200.61
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	663,135.81

（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

（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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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。

基金合同生效日为2005年5月12日，基金业绩截止日为2016年12月31日。基金合同生效以来本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
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%
2012年度	11.45%	1.18%	13.10%	1.15%	−1.65%	0.03%
2013年度	−10.15%	1.40%	−8.47%	1.38%	−1.68%	0.02%
2014年度	56.76%	1.26%	52.75%	1.24%	4.01%	0.02%
2015年度	−3.20%	2.46%	−1.10%	2.34%	−2.10%	0.12%
2016年度	−5.97%	1.33%	−7.75%	1.23%	1.78%	0.10%

十四、基金费用与税收

（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×1.3%÷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×0.2%÷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）基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定，履行纳税义务。

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2016年12月26日刊登的本基金招募说明书进行了更新：

1、在“三、基金管理人”部分，对“（二）主要人员情况”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及相关业务经营情况和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、代销机构信息；

4、在“九、基金份额的申购、赎回与转换”部分，对“（七）申购、赎回与转换费率”进行了更新；

5、在“十、基金的投资”部分，更新了“（九）基金投资组合报告”的内容，更新数据为本基金2017年第1季度报告中的投资组合数据；

6、在“十一、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、在“二十三、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
二〇一七年六月十六日