融通巨潮100指数证券投资基金（LOF）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：二〇一四年十二月

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2014年11月12日，有关财务数据截止日为2014年9月30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。　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，融通基金管理有限公司总经理。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

总经理孟朝霞女士，经济学硕士。历任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理，泰康养老保险股份有限公司副总经理，富国基金管理有限公司副总经理。2014年9月至今任公司总经理。

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，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

公司公募基金投资决策委员会成员：总经理孟朝霞女士，常务副总经理颜锡廉（Allen Yan）先生，基金管理部总监、基金经理吴巍先生，研究策划部总监、基金经理邹曦先生，基金交易部总监王冰心先生。

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2014年6月末，中国工商银行资产托管部共有员工170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6月，中国工商银行共托管证券投资基金380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44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：李淑芳

电话：（010）66190992

（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、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

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：杨菲

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：张作伟

电话：（021）58781234

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：蒋超良

联系人：高阳

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：傅育宁

联系人：邓炯彭

电话：（0755）83198888

客户服务电话：95555

(5)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

(6) 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

(7)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

服务热线：400-8888-001

(8)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

(9)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

(10)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

(11)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

(12)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

(13)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）85127999

客服电话：4006198888

(14)华泰证券股份有限公司

注册地址：南京市中山东路90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

(15)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

(16)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

(17)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：李良

电话：（027）65799999

客服热线：4008-888-999、95579

(18)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

(19)长城证券有限责任公司

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：刘阳

电话：（0755）83516289

客服电话：4006666888

(20)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

(21)华西证券有限责任公司

注册地址：四川省成都市陕西街239号

法定代表人：杨炯洋

联系人：金达勇

电话：（0755）83025723

客服电话：4008888818

(22)申银万国股份有限公司

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）54033888

客服电话：4008895523

(23)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

(24)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

(25)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：4008222211

(26)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

(27)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

(28)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

联系人：孙恺

电话：（010）83561149

客服热线：400-6989-898

(29)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：胡三鲁

电话：（0755）83199599-8166

客服电话：（0755）83199599

(30)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：邱晓星

电话：（0755）83285134

客服电话：95565

(31)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：矫正中

联系人：安岩岩

电话：（0431）85096517

客户服务电话：4006000686

(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

法定代表人：刘学民

联系人：毛诗莉

电话：（0755）25831754

客服电话：4008881888

(33)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

(34)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

(35)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

电话：（010）84183122

客服电话：400818811

(36)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

(37)中国建设银行股份有限公司

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

联系人：王琳

(38)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

(39)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

(40)华林证券有限责任公司

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

(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

(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

客服电话：95566

(43)中国民生银行

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

联系人：董云巍

电话：010-57092615

客服电话：95568

(44)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：4006898888

(45)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：95548

(46)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：牛冠兴

联系人：郑向溢

电话：（0755）82558038

客服热线：4008001001

(47) 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

(48)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：刘莹

电话：（029）87406649

客服电话：95582

(49)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

(50) 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：肖遂宁

联系人：张莉

电话：021-38637673

客户服务电话：95511-3

（51）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

（52）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

（53）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：鹿馨方

电话：（010）63080994

客服电话：4008008899

（54）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

（55）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

（56）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）86702868

客服电话：（0431）82945299

（57）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

（58）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

（59）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：400-181-8188

（60）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

（61）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

联系人：吕慧

电话：（021）58788678

（62）恒泰证券股份有限公司

注册地址：呼和浩特市新城区东风路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

（63）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

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。

(64) 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

(65) 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

(66) 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

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）会计师事务所和经办注册会计师

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、基金的投资组合报告

本基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定，于2014年10月21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2014年9月30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	1,492,446,796.87	94.63
	其中：股票	1,492,446,796.87	94.63
2	固定收益投资	70,158,000.00	4.45
	其中：债券	70,158,000.00	4.45
	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	7,573,665.63	0.48
7	其他资产	6,918,891.32	0.44
8	合计	1,577,097,353.82	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	－	－
B	采矿业	72,828,110.93	4.64
C	制造业	476,033,753.88	30.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,443,694.92	2.19
E	建筑业	39,671,139.09	2.53
F	批发和零售业	24,364,925.86	1.55
G	交通运输、仓储和邮政业	26,470,316.52	1.69
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,716,533.09	3.17
J	金融业	679,535,455.16	43.28
K	房地产业	65,085,172.75	4.15
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	12,268,177.08	0.78
S	综合	12,029,517.59	0.77
	合计	1,492,446,796.87	95.05

2.2 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

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	2,003,956	82,843,541.04	5.28
2	600016	民生银行	11,561,913	72,146,337.12	4.59
3	600036	招商银行	6,017,341	62,520,172.99	3.98
4	601166	兴业银行	4,990,985	51,007,866.70	3.25
5	600000	浦发银行	4,858,774	47,373,046.50	3.02
6	600030	中信证券	3,226,619	42,978,565.08	2.74
7	601328	交通银行	9,387,069	40,270,526.01	2.56
8	600837	海通证券	3,567,202	36,813,524.64	2.34
9	000002	万　科A	3,755,399	34,474,562.82	2.20
10	600519	贵州茅台	187,022	30,321,876.86	1.93

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

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	70,158,000.00	4.47
	其中：政策性金融债	70,158,000.00	4.47
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	70,158,000.00	4.47

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	140207	14国开07	400,000	40,092,000.00	2.55
2	140430	14农发