

**融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书摘要**  
**(2010 年第 2 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 2010 年 11 月 12 日, 有关财务数据和净值表现截止日为 2010 年 9 月 30 日。本基金的托管人中国工商银行股份有限公司已于 2010 年 11 月 30 日复核了本招募说明书中的财务数据, 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

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二部并购业务经理；中信证券企业并购部地区业务主管；上海远东证券有限公司执行总裁、董事、董事长兼总经理。

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。2006 年至今，任新时代证券有限责任公司董事长。

董事刘汝军先生，经济学博士，历任中国证监会上市公司监管部副处长；恒泰证券股份有限公司董事长。

董事弗莱德先生 (Frederick Reidenbach)，现任日兴资产管理有限公司首席财务官和首席行政官。曾服务于 Coopers & Lybrand 会计师事务所；证券公司 Smith Barney。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。

董事 Allen Yan (颜锡廉) 先生，工商管理硕士，现任日兴资产管理有限公司财务企划与分析部部长。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；2006 年至今，任职日兴资产管理有限公司财务企划与分析部部长。

独立董事曹凤岐先生，现任北京大学光华管理学院教授、北京大学金融与证券研究中心主任、国务院学位委员会学科评议组成员、中国金融学会常务理事、北京市金融学会副会长。历任北京大学经济系讲师；北京大学经济学院副教授、教授。

独立董事林义相先生，经济学博士，现任天相投资顾问有限公司董事长兼总经理。历任法国储蓄与信托银行股票投资分析师；中国证券监督管理委员会高级专家、研究信息部副主任、证券交易监控系统负责人；华夏证券有限公司副总裁，2001 年至今，任职天相投资顾问有限公司董事长兼总经理。

独立董事强力先生，现任西北政法学院教授、经济法系副主任、经济法学硕士研究生导师、金融证券法研究中心主任。

董事涂卫东先生，法学硕士，现任中共融通基金管理有限公司支部委员会副书记。历任国务院法制办公室 (原国务院法制局) 财金司副主任科员、主任科员，中国证监会法律部

副处级干部；中国证监会基金监管部副处级干部、正处级干部，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。

监事程燕春先生，高级经济师，现任融通基金管理有限公司上海分公司总经理。历任中国建设银行南昌市分行城北支行行长；中国建设银行基金托管部市场处负责人。2001 年至今，历任融通基金管理有限公司总经理助理、上海分公司总经理。

副总经理刘模林先生，机械工程硕士。历任武汉市信托投资公司证券总部研究部经理、花桥证券营业部经理；融通基金管理有限公司研究部策略和行业研究员、总监、机构理财部总监、基金管理部总监，现同时担任融通领先成长股票基金 (LOF) 基金经理和融通新蓝筹混合基金基金经理。

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；2002 年至今，历任融通基金管理有限公司登记清算部总监、总经理助理。

督察长吴冶平先生，经济学硕士。历任中国银行深圳国际信托咨询公司证券发行部项目经理；深圳市安信财务顾问有限公司上市策划部经理；华夏证券有限公司深圳分公司企业购并部经理；国信证券有限公司投资银行总部副总经理、公司研究部总经理；鹏华基金管理有限公司监事、研究部总监、基金经理助理。2001 年至今，任融通基金管理有限公司督察长。

#### 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，6 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 指数证券投资基金基金经理和融通深证成份指数证券投资基金基金经理。在任职本基金经理前，王建强先生未管理过其他公募基金。

##### (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。

投资决策委员会成员

公司投资决策委员会由副总经理刘模林先生、总经理助理陈晓生先生、基金管理部总监邹曦先生、研究部总监吴巍先生、研究部副总监纪方舟先生等五人组成。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金托管人

#### (一) 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

办公地址：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 334,018,850,026 元

联系电话：(010) 66105799

联系人：蒋松云

#### (二) 主要人员情况

截至 2010 年 9 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 121 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

#### (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 年开展托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，严格履行资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、先进的业务营运系统和专业的托管服务团队，为广大投资者、众多资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。建立了包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、收支账户资金、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、银行理财产品等门类齐全的托管产品体系。截至 2010 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 177 只，其中封闭式 8 只，开放式 169 只。2010 年，中国工商银行凭借在 2009 年国内外托管领域的杰出表现和品牌影响力，先后被英国《全球托管人》、香港《财资》和美国《环球金融》评选为“2009 年度中国最佳托管银行”，本届《财资》评选首次设立了在亚太地区证券和基金服务领域有突出贡献的年度行业领导者奖项，中国工商银行资产托管部周月秋总经理荣获“年度最佳托管银行家”称号，是仅有的两位获奖人之一。自 2004 年以来，中国工商银行资

产托管服务已经获得 23 项国内外大奖。”

#### 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：卢钟

电话：(0755) 26948064

传真：(0755) 26935005

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：林文兵

电话：(021) 38424882

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) 华泰联合证券

注册地址: 深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

法定代表人: 马昭明

联系人: 盛宗凌

电话: (0755) 82492000

传真: (0755) 82492062

客服热线: 400-8888-555、(0755) 25125666

(6) 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

(7) 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

(8) 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

(9) 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

(10) 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

(11) 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)

(12) 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

(13) 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

(14) 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: 杨甦华

电话: (010) 85252564

传真: (010) 85252655

客服热线: (0371) 7639999

(15) 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

(16) 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

(17) 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

(18) 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: 400-8888-999、95579

(19) 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

(20) 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

(21) 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

(22) 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

(23) 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

(24) 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

(25) 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

(26) 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

(27) 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

(28) 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

(29) 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

(30) 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

(31) 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

(32) 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

(33) 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

(34) 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

(35) 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

(36) 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

(37) 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

(38) 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: 郭树清

客户服务电话: 95533

传真: (010) 67598409

联系人: 曲华蕊

(39) 中信金通证券

办公地址: 杭州市中河南路 11 号万凯商务楼 A 座

法定代表人: 刘军

联系人: 龚晓军

电话: (0571) 85783750

传真: (0571) 85783771

(40) 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

(41) 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

(42) 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

(43) 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

(44) 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

(45) 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

(46) 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

(47) 安信证券

注册地址: 深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 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

法人代表人: 牛冠兴

联系人: 李瑾

电话: (0755) 82825555

传真: (0755) 82825550

客服热线: (020) 96210

(48) 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

(49) 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

(50) 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

(51) 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

(52) 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

(53) 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

(54) 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

(55) 广发华福证券有限责任公司

办公地址：福州五四路 157 号新天地大厦 10 层

法定代表人：黄金琳

电话: (0591) 87383623

联系人: 张腾

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: 康达律师事务所

注册地址: 北京市朝阳区建国门外大街 19 号国际大厦 703 室

办公地址: 北京市朝阳区建国门外大街 19 号国际大厦 703 室

法定代表人: 傅洋

联系人: 娄爱东 王琪

经办律师: 李赫 肖钢

电话: (010) 85262828

传真: (010) 85262826

(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: 单峰

经办注册会计师: 马颖旒、单峰

**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; 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 2010 年 11 月 30 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 2010 年 9 月 30 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	2,678,361,998.83	94.73
	其中:股票	2,678,361,998.83	94.73
2	固定收益投资	101,470,000.00	3.59
	其中:债券	101,470,000.00	3.59
	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	42,699,420.97	1.51
6	其他资产	4,721,531.60	0.17
7	合计	2,827,252,951.40	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	8,610,523.63	0.31
B	采掘业	354,712,398.79	12.58
C	制造业	649,089,384.60	23.02
C0	食品、饮料	130,297,011.36	4.62
C1	纺织、服装、皮毛	12,595,266.39	0.45
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	37,239,352.19	1.32
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	198,275,011.36	7.03
C7	机械、设备、仪表	243,681,123.10	8.64
C8	医药、生物制品	27,001,620.20	0.96
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	79,265,457.77	2.81
E	建筑业	73,870,543.02	2.62
F	交通运输、仓储业	101,113,995.41	3.59
G	信息技术业	88,324,501.54	3.13

H	批发和零售贸易	78,637,326.38	2.79
I	金融、保险业	1,064,880,364.16	37.77
J	房地产业	133,772,536.56	4.74
K	社会服务业	14,919,924.87	0.53
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	31,165,042.10	1.11
	合计	2,678,361,998.83	95.00

## (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)	市 值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	3,206,615	169,597,867.35	6.02
2	600036	招商银行	12,269,962	158,896,007.90	5.64
3	601328	交通银行	17,494,654	101,468,993.20	3.60
4	600016	民生银行	19,747,788	100,713,718.80	3.57
5	601166	兴业银行	3,757,773	86,879,711.76	3.08
6	600000	浦发银行	6,486,247	84,061,761.12	2.98
7	600030	中信证券	6,120,511	65,122,237.04	2.31
8	000002	万 科 A	7,559,131	63,496,700.40	2.25
9	002024	苏宁电器	3,609,254	57,639,786.38	2.04
10	000858	五 粮 液	1,598,011	54,859,717.63	1.95

## 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	101,470,000.00	3.60
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	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	101,470,000.00	3.60

## 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	0801053	08 央行票 据 53	1,000,000	101,470,000.00	3.60

## 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	2,100,520.47
4	应收利息	1,818,386.76
5	应收申购款	302,624.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,721,531.60

(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 年上半年	-28.99%	1.54%	-28.17%	1.54%	-0.82%	0.00%
-----------	---------	-------	---------	-------	--------	-------

#### 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：

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

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

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

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：

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

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

申购份额 =  $4,926.11 / 1.200 = 4,105.09$  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：

申购份额 = 申购金额 / 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：

申购份额 =  $5,000 / 1.200 = 4,166.67$  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

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购手续费 = 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

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：

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

申购手续费 =  $10,000 - 9,852.22 = 147.78$  元

申购份额 =  $9,852.22 / 1.025 = 9,611.92$  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。

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

退款金额 =  $10,000 - 9,851.28 - 147.78 = 0.94$  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 =  $10,000 \times 1.200$  元 = 12,000 元

赎回费 =  $12,000 \times 0.3\%$  = 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  $\times$  赎回当日基金份额净值

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

赎回费 = 赎回总金额  $\times$  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 =  $10,000 \times 1.200$  元 = 12,000 元

后端认购费 =  $10,000 \times \text{最小值}(1.000, 1.200) \times 1.6\%$  = 160 元

赎回费 =  $12,000 \times 0.3\%$  = 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 =  $10,000 \times 1.200$  元 = 12,000 元

后端申购费 =  $10,000 \times \text{最小值}(1.100, 1.200) \times 1.9\%$  = 209 元

赎回费 =  $12,000 \times 0.3\%$  = 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工作;

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重大事项，但基金管理人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) 上述一中第 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 2010 年 6 月 25 日刊登的本基金招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在“三、基金管理人”部分中,对“(一)基金管理人概况”和“(二)主要人员情况”进行了更新;

2、在“四、基金托管人”部分,对基金托管人的基本情况及相关业务经营情况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”的地址和“代销机构”的相关信息;

4、在“十、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 2010 年第 3 季度报告中的投资组合数据;

5、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;

6、在“二十三、其他应披露的事项”部分,对自上次招募说明书截止日以来与本基金相关的公告信息进行了列表说明。

融通基金管理有限公司

2010 年 12 月 25 日