

融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)  
更新招募说明书摘要  
(2019 年第 2 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：二〇一九年十二月

**融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书摘要**  
**(2019 年第 2 号)**

**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, 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。

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 2019 年 5 月 12 日, 其中有关财务数据截止日为 2019 年 3 月 31 日, 净值表现截止日为 2018 年 12 月 31 日 (本招募说明书中的财务资料未经审计), 根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订的内容截止日为 2019 年 12 月 31 日。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容, 将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

**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联合全球投资主管兼联合首席投资官, 兼任 ARK Investment Management GP LLC 董事会列席代表。历任 M&T Bank 分析员, FGIC (GE Capital 通用资本的子公司) 交易员, General Reinsurance 基金经理, CGA Investment Management 高级基金经理, Structured Credit Partners LLC 联合创始人兼首席投资官, Wachovia Corporation 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 (Manulife Asset Management) 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 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, 清华大学 EMBA。历任新时代证券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, 清华大学 EMBA。历任新时代证券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。

督察长涂卫东先生, 法学硕士。曾在原国务院法制办公室财金司、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), 8 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 日起至 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 日起至 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 日起至 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 日起至 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

公司权益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: 陈四清

注册资本: 人民币 34,932,123.46 万元

联系电话: 010-66105799

联系人: 郭明

## (二) 主要人员情况

截至 2018 年 12 月, 中国工商银行资产托管部共有员工 202 人, 平均年龄 33 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 2018 年 12 月, 中国工商银行共托管证券投资基金 923 只。自 2003 年以来, 中国工商银行连续十五年获得香港《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 64 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。

## 五、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

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北京分公司

办公地址: 北京市西城区太平桥大街 84 号丰汇时代大厦东翼 5 层 502-507 房间

邮政编码: 100032

联系人: 柴功

电话: (010) 66190982

(3) 融通基金管理有限公司上海分公司

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

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: 韦荣涛

联系电话: (0755) 26947504

2、场内销售机构:

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销售场内业务。

3、场外销售机构:

(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: 陈四清

电话: (010) 66107900

客户服务电话: 95588

(2) 交通银行股份有限公司 (仅销售前端)

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: 彭纯

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 (仅销售前端)

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: 田国立

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: 李庆萍

电话: (010) 65541405

(7) 中国银行股份有限公司 (仅销售前端)

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人: 刘连舸(代)

客服电话: 95566

(8) 中国民生银行股份有限公司 (仅销售前端)

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 (仅销售前端)

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: 李晓鹏

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 (仅销售前端)

注册办公所: 广东省深圳市罗湖区深南东路 5 0 4 7 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 (仅销售前端)

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)

(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](http://www.bankofshanghai.com)

(14) 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

传真: (021) 62580818

客服电话: 4008888666

(15) 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: 陈共炎

联系人: 辛国政

电话: (010) 83575407

客服电话: 4008-888-8888

(16) 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: 周杰

联系人: 涂洋

电话: (021) 23219275

服务热线: 400-8888-001

(17) 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

(18) 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

(19) 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:95587

(20) 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:胡月茹

电话:(021) 63325888

客服电话:95503

(21) 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

(22) 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:冯鹤年

联系人:韩秀萍

电话:(010) 85127999

客服电话:4006198888

(23) 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

客户服务电话：95597

(24) 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

(25) 平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路荣超大厦 4036 号 16-20 层

法定代表人：何之江

联系人：王阳

电话：(021) 38637436

客服电话：95511 转 8

(26) 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：李新华

联系人：奚博宇

电话：(021) 68751860

客服热线：4008-888-999、95579

(27) 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：杨俊帆

电话：(0512) 65581136

客服电话：4008601555

(28) 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: 曹宏

联系人: 李嘉禾

电话: (0755) 83516289

客服电话: 4006666888

(29) 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: 樊忠亚

电话: (0551) 65161821

客服电话: 95318, 4008096518

(30) 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

(31) 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

联系人: 余敏

电话: (021) 33389888

客服热线: 95523 或 4008895523

(32) 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

(33) 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: 王万君

电话: (025) 83367888

客服电话: 4008285888

(34) 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: 占文驰

电话: (0791) 86283080

客服电话: 400822211

(35) 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: 周健男

联系人: 李芳芳

电话: (021) 22169081

客服电话: 95525

(36) 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: 沈刚

电话: (0510) 82831662

客服电话: (0510) 2588168

(37) 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

(38) 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: 姜昧军

联系人: 王雯

电话: (0755) 83199599-8166

客服电话: 4008-323-000

(39) 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: 霍达

联系人: 黄婵君

电话: (0755) 82960167

客服电话: 95565

(40) 东北证券股份有限公司

注册地址: 长春市生态大街 6666 号

法定代表人: 李福春

联系人: 付静雅

电话: (0431) 85096517

客户服务电话: 95360

(41) 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: 王叔胤

电话: (0755) 25831754

客服电话: 4008881888

(42) 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

(43) 东莞证券股份有限公司

注册地址: 东莞市莞城区可园南路 1 号

法定代表人: 陈照星

联系人: 梁健伟

电话: (0769) 22119462

客户服务电话: 95328

(44) 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: 刘河斌

电话: (010) 84183389

客服电话: 400818811

(45) 万联证券股份有限公司

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

(46) 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: 李琦

联系人: 余敏

电话: 010-88085858

(47) 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: 林立



联系人: 杨琳

电话: (0755) 82707855

客服电话: 4001883888

(48) 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

(49) 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

(50) 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: 刘志斌

电话: (0755) 82558038

客服热线: 4008001001

(51) 西部证券股份有限公司

注册地址: 西安市东大街 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

(52) 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：施华

联系人：丁敏

联系电话：(0731) 85832463

客服电话：95571

(53) 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：邵珍珍

电话：(021) 68475888

客服电话：4008918918

(54) 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：张晓辰

电话：(010) 63080994

客服电话：4008008899

(55) 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

(56) 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：张佑君

联系人：马静懿

电话：(010) 60838995

客服电话：4008895548

(57) 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) 4974437

客服电话：(0471) 4961259

(58) 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

(59) 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：秦雨晴

电话：021-20315290

客服电话：95538

(60) 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：廖庆轩

联系人：周青

电话：023-63786141

客服电话：4008096096

(61) 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

(62) 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

联系人: 刘婧漪

电话: 028-86690057

客服电话: 4006-600109

(63) 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

(64) 北京晟视天下基金销售有限公司

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: 许爽

客服电话: 4008188866

(65) 中国民族证券有限责任公司

办公地址: 北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

法定代表人: 姜志军

联系人: 丁敏

电话: (0731) 85832463

客服电话: 400-889-5618;

(66) 东海证券股份有限公司

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: 王连志

联系人: 杨天枝

电话: (0755) 82558038

客服电话: 4008001001

(67) 天相投资顾问有限公司 (仅销售前端)

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

(68) 诺亚正行基金销售有限公司

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](http://www.noah-fund.com)

(69) 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

办公地址: 深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

法定代表人: 薛峰

电话: 0755-33227950

传真: 0755-33227951

联系人: 龚江江

客服热线: 4006-788-887

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

(70) 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: 上海市徐汇区宛平南路 88 号金座大楼 (东方财富大厦)

法定代表人: 其实

联系人: 潘世友

电话: 021-54509977

传真: 021-64385308

客服电话: 95021 / 4001818188

网址: [www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

客服电话: 400-181-8188

(71) 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

(72) 上海长量基金销售有限公司

注册地址: 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址: 上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人: 张跃伟

电话: 021-2069-1831

传真: 021-2069-1861

联系人: 王敏

客服热线: 4008202899

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

(73) 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 1002 室

办公地址: 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: 010-85657353

传真: 010-65884788

联系人: 陈慧慧

客服热线: 4009200022

公司网站: <http://licaike.hexun.com/>

(74) 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

(75) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址: 杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址: 杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号 同花顺大楼

法定代表人: 凌顺平

电话: 0571-88911818

传真: 0571-86800423

联系人: 董一锋

客服热线: 4008-773-772

公司网站: [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(76) 嘉实财富管理有限公司 (仅销售前端)

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

(77) 上海汇付基金销售有限公司

注册地址: 上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元

办公地址: 上海市徐汇区宜山路 700 号普天软件园 C5 幢

法定代表人: 金佶

电话: 021-34013996

联系人: 甄宝林

客服热线: 021-34013999

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

(78) 深圳富济基金销售有限公司

注册地址: 深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元

办公地址: 深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3203A 单元

法定代表人: 刘鹏宇

电话: 0755-83999907-8814

传真: 0755-83999926

联系人: 刘勇

客服热线: 0755-83999907

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

(79) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址: 深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704

办公地址: 北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

法定代表人: 洪弘

电话: 010-83363101

联系人: 文雯

客服热线: 400-166-1188

公司网站: [8.jrj.com.cn](http://8.jrj.com.cn)

(80) 北京钱景基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村东路 18 号 1 号楼 11 层 B-1108

办公地址: 北京市海淀区中关村东路 18 号 1 号楼 11 层 B-1108

法定代表人: 赵荣春



电话: 010-59422766

联系人: 姚付景

客服热线: 400-893-6885

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

(81) 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: 上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人: 黄炜

电话: 021-50712782

传真: 021-50710161

联系人: 徐亚丹

客服热线: 400-799-1888

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

(82) 上海陆金所基金销售有限公司 (仅销售前端)

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: 胡学勤

联系人: 程晨

电话: 021-20665952

客户服务电话: 4008219031

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

客户服务电话: 4008219031

(83) 珠海盈米财富管理有限公司 (仅销售前端)

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

(84) 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: 上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 18 层

法定代表人: 李兴春

电话: 021-60195121

传真: 021-61101630

联系人: 郭丹妮

客服热线: 95733

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

(85) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村 e 世界 A 座 1108 室

办公地址: 北京市海淀区中关村 e 世界 A 座 1108 室

法定代表人: 王伟刚

电话: 010-56251471

传真: 010-62680827

联系人: 王骁骁

客服热线: 010-56251471

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

(86) 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](http://www.xds.com.cn)

(87) 一路财富 (北京) 基金销售股份有限公司

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](http://www.yilucaifu.com)

(88) 北京虹点基金销售有限公司 (仅销售前端)

注册地址: 北京市朝阳区工体北路甲 2 号群房 2 层 22 单元

办公地址: 北京市朝阳区工体北路甲 2 号群房 2 层 22 单元

法定代表人: 郑毓栋

电话: 400-618-0707

传真: 010-65951887

联系人: 牛亚楠

客服热线: 400-618-0707

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

(89) 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>

(90) 奕丰基金销售有限公司

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道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人: TEO WEE HOWE

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](http://www.ifastps.com.cn)

(91) 北京肯特瑞基金销售有限公司 (仅销售前端)

注册地址: 北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

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: 江卉

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](http://jr.jd.com)

(92) 万家财富基金销售 (天津) 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: 010-59013842

传真: 010-59013707

联系人: 王芳芳

客服热线: 010-59013842

公司网站: <http://www.wanjiawealth.com/>

(93) 通华财富 (上海) 基金销售有限公司 (仅销售前端)

注册地址: 上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址: 上海市浦东新区金沪路 55 号通华科技大厦 7 层

法定代表人: 沈丹义

联系人: 杨徐霆

电话: 021-60818249

客户服务电话: 400-101-9301

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

(94) 上海联泰基金销售有限公司

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

法定代表人: 尹彬彬

电话: 021-52822063

传真: 021-52975270

联系人: 兰敏

客服热线: 400-166-6788

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

(95) 中证金牛 (北京) 投资咨询有限公司 (仅销售前端)

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: 010-59336544

传真: 010-59336586

联系人: 沈晨

客服热线: 4008-909-998

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

(96) 上海华夏财富投资管理有限公司 (仅销售前端)

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: 010-88066184

传真: 010-63136184

联系人: 张静怡

客服热线: 400-817-5666

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

(97) 上海挖财基金销售有限公司 (仅销售前端)

注册地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人: 冷飞

电话: 021-50810687

传真: 021-58300279

联系人: 孙琦

客服热线: 021-50810673

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

(98) 蚂蚁 (杭州) 基金销售有限公司 (仅销售前端)

注册地址: 浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 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: 祖国明

联系人: 韩爱彬

客服电话: 4000-766-123

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

(99) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

办公地址: 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人: 钟斐斐

电话: 010-61840688

传真: 010-61840699

联系人: 戚晓强

客服热线: 4000618518

公司网站: <https://danjuanapp.com/>

(100) 方德保险代理有限公司 (原金惠家保险代理有限公司)

注册地址: 北京市西城区阜成门大街 2 号 19 层 A2017

办公地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号楼 7 层 711

法定代表人: 林柏均

电话: 010-68091380

传真: 010-68091380

联系人: 胡明哲

客服热线: 010-64068617

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

(101) 腾安基金销售(深圳)有限公司(仅销售前端)

注册地址: 广东省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: 深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 楼

法定代表人: 刘明军

联系电话: 18621730132

联系人: 赵晨

客服电话: 95017(拨通后转 1 再转 8)

公司网站: <https://www.tenganxinxi.com/>

(102) 南京苏宁基金销售有限公司(仅销售前端)

注册地址: 江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址: 江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人: 王锋

电话: 025-66996699

传真: 025-66996699

联系人: 张云飞

客服热线: 025-66996699

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

(103) 上海基煜基金销售有限公司

注册地址: 上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室

办公地址: 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人: 王翔

电话: 021-65370077

传真: 021-55085991

联系人: 许付漪

客服热线: 400-820-5369

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

(104) 上海凯石财富基金销售有限公司 (仅销售前端)

注册地址: 上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址: 上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人: 陈继武

电话: 021-63333389

传真: 021-63333390

联系人: 冯强

客服热线: 4006-433-389

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

(105) 大连网金基金销售有限公司 (仅销售前端)

注册地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层

办公地址: 辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层

法定代表人: 樊怀东

电话: 0411-39027810

传真: 0411-39027835

联系人: 于秀

客服热线: 4000899100

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

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办理销售本基金, 并在基金管理人网站上更新。

## (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: 薛竞、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%,其中

现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 2019 年 5 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 2019 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	734,846,116.90	94.72

	其中：股票	734,846,116.90	94.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	22,603,795.05	2.91
	其中：债券	22,603,795.05	2.91
	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	15,993,685.86	2.06
8	其他资产	2,343,099.38	0.30
9	合计	775,786,697.19	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	22,602,547.80	2.92
B	采矿业	18,419,889.58	2.38
C	制造业	245,803,610.82	31.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	387,200.00	0.05
E	建筑业	23,857,160.75	3.09
F	批发和零售业	2,807,400.00	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	12,848,925.12	1.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,897,356.59	2.45
J	金融业	316,050,277.63	40.90
K	房地产业	21,725,915.92	2.81
L	租赁和商务服务业	6,665,822.52	0.86
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	690,066,106.73	89.30

## 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	2,234,843.00	0.29
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,418,026.63	2.12
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	2,366,760.00	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,601,311.54	1.11
J	金融业	11,694,879.00	1.51
K	房地产业	1,631,590.00	0.21
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	1,832,600.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	44,780,010.17	5.79

## 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	956,234	73,725,641.40	9.54
2	600036	招商银行	1,042,461	35,360,277.12	4.58
3	600519	贵州茅台	39,747	33,943,540.53	4.39
4	601166	兴业银行	1,272,831	23,127,339.27	2.99
5	300498	温氏股份	556,713	22,602,547.80	2.92
6	600030	中信证券	893,400	22,138,452.00	2.86
7	000651	格力电器	425,699	20,097,249.79	2.60
8	600276	恒瑞医药	276,476	18,087,059.92	2.34
9	601288	农业银行	4,750,908	17,720,886.84	2.29
10	000858	五粮液	185,824	17,653,280.00	2.28

## 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	002142	宁波银行	383,900	8,154,036.00	1.06
2	600782	新钢股份	715,500	4,350,240.00	0.56
3	601128	常熟银行	454,200	3,406,500.00	0.44
4	600498	烽火通信	105,700	3,330,607.00	0.43
5	600570	恒生电子	30,485	2,669,266.60	0.35

## 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	5,015,000.00	0.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	17,024,300.00	2.20
	其中：政策性金融债	17,024,300.00	2.20
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)	564,495.05	0.07
8	同业存单	-	-



9	其他	-	-
10	合计	22,603,795.05	2.93

**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	180407	18 农发 07	100,000	10,017,000.00	1.30
2	019566	17 国债 12	50,000	5,015,000.00	0.65
3	018005	国开 1701	50,000	5,000,500.00	0.65
4	108901	农发 1801	20,000	2,006,800.00	0.26
5	110053	苏银转债	4,640	463,995.93	0.06

**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	80,497.19
2	应收证券清算款	1,488,889.35
3	应收股利	-
4	应收利息	695,146.43
5	应收申购款	78,566.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,343,099.38

(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

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	603379	三美股份	66,546.36	0.01	新股流通受限

### 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，本基金最近 10 个完整会计年度（截至 2018 年 12 月 31 日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

融通巨潮 100 指数 A/B

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
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%
2017 年度	23.85%	0.65%	25.99%	0.64%	-2.14%	0.01%
2018 年度	-20.33%	1.31%	-21.43%	1.30%	1.10%	0.01%

融通巨潮 100 指数 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 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
2017 年 7 月 5 日至 2017 年 12 月 31 日	11.64%	0.73%	12.08%	0.71%	-0.44%	0.02%
2018 年度	-11.32%	1.15%	-11.94%	1.14%	0.62%	0.01%

注：本基金于 2017 年 7 月 5 日增设了 C 类份额。

#### 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) C 类基金份额的销售服务费；
- (4) 基金的证券交易费用；
- (5) 基金合同生效后的信息披露费用；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金合同生效后的会计师费和律师费；
- (8) 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) 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:

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

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两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。

(4) 上述(一)中第 4—8 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项纳税主体, 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《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求, 对本基金管理人于最新一期刊登的本基金招募说明书进行了更新:

根据 2019 年 9 月 1 日生效的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及本基金基金合同、托管协议的修订, 更新招募说明书的“重要提示”、“一、绪言”、“二、释义”、“三、基金管理人”、“五、相关服务机构”、“九、基金份额的申购、赎回与转换”、“十三、基金资产的估值”、“十四、基金的收益分配”、“十六、基金的会计与审计”、“十七、基金的信息披露”、“十九、基金的终止与清算”、“二十、基金合同的内容摘要”、“二十一、基金托管协议的内容摘要”等章节内容。

融通基金管理有限公司

二〇一九年十二月三十一日