

富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金  
更新招募说明书（摘要）  
（2013 年第 1 号）

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

## 【重要提示】

富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可[2013]206号文核准募集，本基金的基金合同于2013年5月7日生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

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。

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合同当事人之间权利、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。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书已经本基金托管人复核。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2013年11月7日，有关财务数据和净值表现截止日为2013年9月30日（财务数据未经审计）。

### 一、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：国海富兰克林基金管理有限公司

注册地址：广西南宁市西乡塘区总部路1号中国—东盟科技企业孵化基地一期C-6栋二层

办公地址：上海浦东世纪大道8号上海国金中心二期9层

法定代表人：吴显玲

成立日期：2004年11月15日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]145号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.2亿元人民币

存续期限：50年

联系人：沈增

联系电话：021-3855 5555

股权结构：国海证券股份有限公司（原名“国海证券有限责任公司”）持有51%股权，邓普顿国际股份有限公司持有49%股权

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员：

董事长吴显玲女士，中共党员，管理学硕士，经济师。历任中国人民银行广西壮族自治区金融管理处主任科员，广西证券交易中心副总经理（主持全面工作），广西证券登记有限责任公司法定代表人、总经理，广西证券有限责任公司副总裁，国海证券有限责任公司副总裁，国海富兰克林基金管理有限公司督察长。现任国海富兰克林基金管理有限公司董事长、代为履行总经理职责。

副董事长 William Y. Yun 先生，工商管理学硕士，历任 Fiduciary Trust Company International 总裁、Franklin Templeton Institutional, LLC 总裁，现任富兰克林邓普顿投资集团执行副总裁。

董事张雅锋女士，中共党员，研究生学历。历任广西壮族自治区商业厅副处长、处长，广西凭祥市委副书记、广西商业大厦副总经理、广西南方商业集团公司董事长兼总经理、党总支部书记，广西壮族自治区证券办发行部主任、中国证监会南宁特派办副主任、广西投资集团有限公司副总经理、广西证券有限责任公司增资扩股筹备组组长、国海证券有限责任公司董事长、党委书记，国海富兰克林基金管理有限公司董事长、董事。现任广西投资集团有限公司董事、国海证券股份有限公司董事长、党委书记、国海良时期货有限公司董事、国海创新资本投资管理有限公司董事。

董事齐国旗先生，中共党员，经济学硕士。历任河南大学党委组织部干部科科长，君安证券有限责任公司债券业务部总经理助理、副总经理，国泰君安证券股份有限公司债券业务一部、资本运作总部副总经理、收购兼并总部上海业务部负责人，民生证券有限责任公司副总经理，国海证券有限责任公司副总裁、总裁，国海良时期货有限公司董事，国海富兰克林

基金管理有限公司董事。现任国海证券股份有限公司总裁、国海创新资本投资管理有限公司董事，国海证券股份有限公司深圳分公司总经理。

董事胡德忠先生，中共党员，管理学博士，经济师。历任广西证券有限责任公司深圳营业部总经理助理、副总经理，深圳深南中路证券营业部总经理，广西证券（2011年10月增资扩股并更名为国海证券）有限责任公司公司总经理助理兼经纪业务部总经理，国海富兰克林基金管理有限公司副总经理，上海凯石投资管理有限公司董事副总经理，国海证券有限责任公司经纪业务事业总部总经理、公司常务副总裁兼经纪业务事业总部总经理，国海证券股份有限公司经纪业务事业总部总经理。现任国海证券股份有限公司公司常务副总裁，国海创新资本投资管理有限公司董事。

董事Gregory E. McGowan先生，博士学历。现任邓普顿国际股份有限公司执行副总裁，国海富兰克林基金管理有限公司股东代表等职务。

董事张伟先生，硕士研究生学历。历任澳纽银行集团（悉尼）企业银行主任、香港上海汇丰银行国际信托有限公司副总裁、银行家信托有限公司（英国）联席董事、德意志信托（香港）有限公司董事、德意志银行（香港）副总裁。现任富兰克林邓普顿投资（亚洲）有限公司大中华区总监及董事。

独立董事黄湘平先生，中共党员，硕士研究生学历，兼职教授。历任湖南省人大常委会处长、主任，湖南人大常委法工委副主任，湖南省体改委副主任，湖南省证券委副主任，湖南省证监会主任（党组书记），中国证监会武汉办主任、党委书记，中国证监会湖北局局长、党委书记，中国证券业协会副会长、会长、党委书记。现任中国证券业协会咨询委员会副主任。

独立董事张忠国先生，中共党员，硕士研究生学历，高级会计师。历任广西柳州地区财政局副局长，广西鹿寨县人民政府副县长，柳州地区行署副秘书长、财办主任，广西财政厅预算处处长，广西财政厅总会计师、副厅长（享受正厅级待遇）。现任广西注册会计师协会会长、广西五洲交通股份有限公司独立董事。

独立董事洪荣光先生，MBA商学硕士。历任台湾亚洲证券股份有限公司董事长及第一大股东（后与元大京华证券股份有限公司合并）、H&Q（Hambrecht & Quist Group）汉茂风险投资公司董事、越南国家投资基金公司董事、邓普顿新兴市场信托股份有限公司董事、邓普顿开发中国投资信托基金（卢森堡）董事、台股指数基金公司（英国）董事、菲律宾信安银行董事、富兰克林邓普顿国际基金董事、益民基金管理有限公司独立董事。现任兴亚置业集团（中国）董事长、亚洲环球证券公司（香港）董事长、菲律宾信安银行独立董事。

独立董事陈伟力女士，大学本科学历。历任美国斯坦福大学访问学者，中国新技术创业投资公司副总经理，中国国际技术智力合作公司总经理兼党委书记。现任天津市海运股份有限公司独立董事。

## 2、监事会成员

监事余天丽女士，经济学学士。历任富达基金（香港）有限公司投资服务代表，Asiabondportal.com营销助理，富达基金（香港）有限公司亚洲区项目经理，英国保诚资产管理（新加坡）有限公司亚洲区战略及产品发展部副董事，瑞士信贷资产管理（新加坡）有限公司亚洲区产品发展部总监，工银瑞信基金管理有限公司专户投资部产品负责人。现任富兰克林邓普顿资本控股有限公司（富兰克林邓普顿投资集团全资子公司）亚洲区产品策略部董事。

监事李慧女士，中共党员，硕士研究生学历。历任广西证券有限责任公司上海营业部财务部及交易部经理，广西证券有限责任公司稽核部总经理，国海证券有限责任公司稽核监察部总经理、总裁助理，国海证券股份有限公司总裁助理。现任国海证券股份有限公司合规总监、国海创新资本投资管理有限公司监事。

监事张志强先生，CFA，纽约州立大学（布法罗）计算机科学硕士，中国科学技术大学数学专业硕士。历任美国Enreach Technology Inc.软件工程师，海通证券股份有限公司研究所高级研究员，友邦华泰基金管理有限公司高级数量分析师，国海富兰克林基金管理有限公司首席数量分析师、风险控制部总经理、业务发展部总经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司量化与指数投资总监、金融工程部总经理、国富沪深300指数增强基金基金经理、职工监事。

监事戴刚先生，工商管理硕士、专业会计硕士，FRM、CFA。历任重庆工程建设总公司预算管理部助理工程师、韩国三星集团上海代表处建设项目投资经理、湘财证券有限责任公司资产管理部高级经理、浦银安盛基金管理有限公司筹备组成员、风险管理部总监、职工监事。现任国海富兰克林基金管理有限公司风险控制部总经理、职工监事。

## 3、经营管理层人员

副总经理张晓东先生，美国多米尼克学院国际经济政治分析硕士。历任中国企业管理无锡培训中心助教、中欧管理研究生项目（现改为中欧国际管理学院）助教/中方院长助理，无锡虹美电器集团销售/项目经理，美国纽堡太平洋投资管理公司高级投资经理，阳光国际

管理公司董事， 中信资本市场控股公司董事（非董事会成员）， 国海富兰克林基金管理有限公司基金经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司副总经理兼公募基金投资决策委员会主席， 首席基金经理， 管理国富弹性市值股票基金及国富深化价值股票基金。

副总经理徐荔蓉先生， CFA， CPA（非执业）， 律师（非执业）， 中央财经大学经济学硕士。历任中国技术进出口总公司金融部副总经理、融通基金管理有限公司基金经理、申万巴黎基金管理有限公司（现“申万菱信基金管理有限公司”）基金经理、国海富兰克林基金管理有限公司高级顾问、资产管理部总经理兼投资经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司副总经理、投资总监、研究分析部总经理， 国富中国收益混合基金和国富研究精选股票基金基金经理。

副总经理李彪先生， 硕士研究生， 副研究员。历任内蒙古大学经济系讲师、中国证监会海南证监局证券期货市场监管处处长、证券机构监管处处长、稽查处处长、国海富兰克林基金管理有限公司督察长助理、督察长。现任国海富兰克林基金管理有限公司副总经理。

注：本报告期内， 经国海富兰克林基金管理有限公司第三届董事会第二十二次会议审议通过， 自2013年9月9日起李雄厚先生不再担任本基金管理公司总经理职务（详情请参见2013年9月10日刊登的《国海富兰克林基金管理有限公司高级管理人员变更公告》）。在新任总经理正式就任前， 由董事长吴显玲女士代为履行总经理职责， 吴显玲女士简历详见董事会成员介绍。

#### 4、督察长

督察长储丽莉女士， 中共党员， 英国伦敦大学亚非学院法律硕士。历任上海物资贸易中心股份有限公司法律顾问、投资经营部副总经理、李宁体育（上海）有限公司法律顾问。2005年加入国海富兰克林基金管理有限公司， 先后担任公司法律顾问、高级法律顾问、监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理。自2006年起， 还同时兼任公司董事会秘书。现任国海富兰克林基金管理有限公司督察长兼董事会秘书、高级法律顾问。

#### 5、本基金基金经理基本情况

##### 现任基金经理

赵晓东先生， 香港大学MBA。历任淄博矿业集团项目经理， 浙江证券分析员， 上海交大高新技术股份有限公司高级投资经理， 国海证券有限责任公司行业研究员， 国海富兰克林基金管理有限公司研究员、高级研究员、国富弹性市值股票基金和国富潜力组合股票基金的

基金经理助理。现任国海富兰克林基金管理有限公司国富沪深300指数增强基金、国富中小盘股票基金和国富焦点驱动混合基金的基金经理。

历任基金经理

无，该基金自成立以来尚未发生基金经理离任。

## 6、投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度。

投资决策委员会由下述委员组成：吴显玲女士（董事长、代为履行总经理职责）；张晓东先生（公司副总经理、公募基金投资决策委员会主席、首席基金经理）；徐荔蓉先生（公司副总经理、投资总监、研究分析部总经理、基金经理）；朱国庆先生（权益投资总监、基金经理）；刁晖宇先生（固定收益投资总监、QDII投资总监、基金经理）；张志强先生（量化与指数投资总监、金融工程部总经理、基金经理、职工监事）；戴刚先生（风险控制部总经理、职工监事）；赵晓东先生（基金经理）。

储丽莉女士（督察长）有权列席投资决策委员会的任何会议。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座9层

法定代表人：蒋超良

成立日期：2009年1月15日

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-63201510

传真：010-63201816

联系人：李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院

批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计,并获得无保留意见的 SAS70 审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在 2010 年首届““金牌理财”TOP10 颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004 年 9 月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 140 余名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止 2013 年 9 月 30 日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 176 只,包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、



银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型证券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数

证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）、交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国 7 天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财 21 天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金（LOF）、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财 21 天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家 14 天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中

国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、南方稳利一年定期开放债券型证券投资基金、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、华夏永福养老理财混合型证券投资基金、嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、易方达投资级信用债债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华润元大保本混合型证券投资基金、长盛双月红一年期定期开放债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金。

## （二）基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权

### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

### （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构：

名称：国海富兰克林基金管理有限公司

注册地址：广西南宁市西乡塘区总部路1号中国—东盟科技企业孵化基地一期C-6栋二层

办公地址：上海浦东世纪大道8号上海国金中心二期9层

法定代表人：吴显玲

联系人：白雨杉

联系电话：021-3855 5678

传真：021-6887 0708

#### 2、代销机构：

##### （1）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

法定代表人：蒋超良

联系人：刘一宁

电话：010-85108227

传真：010-85109219

客户服务电话：95599

公司网址：www.abchina.com

(2) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

客户服务电话：95566

公司网址：www.boc.cn

(3) 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

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

电话：010-66275654

传真：010-66275654

联系人：王琳

客户服务电话：95533

公司网址：www.ccb.com

(4) 交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：牛锡明

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

(5) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁  
电话：0755-83198888  
传真：0755-83195109  
联系人：邓炯鹏  
客户服务电话：95555  
公司网址：www.cmbchina.com

(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8号富华大厦C座  
地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座  
传真：010-65550827  
联系人：丰靖  
客户服务电话：95558  
公司网址：bank.ecitic.com

(7) 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：董文标  
传真：010-57092611  
联系人：杨成茜  
客户服务电话：95568  
公司网址：www.cmbc.com.cn

(8) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街25号光大中心  
法定代表人：唐双宁  
联系人：李伟  
电话：010-63636155  
传真：010-63630661  
客户服务电话：95595

公司网址: [www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

(9) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址: 上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址: 上海市中山东一路 12 号

法定代表人: 吉晓辉

电话: 021-61618888

传真: 021-63604199

联系人: 唐苑

客户服务电话: 95528

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

(10) 兴业银行股份有限公司

住所: 福州市湖东路 154 号

办公地址: 上海市江宁路 168 号兴业大厦 9 楼

法定代表人: 高建平

联系人: 刘玲

客户服务电话: 95561

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

(11) 渤海银行股份有限公司

注册地址: 天津市河西区马场道 201-205 号

办公地址: 天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人: 刘宝凤

联系人: 王宏

传真: 022-58316569

客户服务电话: 400-888-8811

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

(12) 杭州联合农村商业银行股份有限公司

注册地址：杭州市建国中路99号

法定代表人：张晨

联系人：胡莹

电话：0571-87923324

传真：0571-87923214

客服电话：96592

公司网址：www.urcb.com

(13) 苏州银行股份有限公司

注册地址：中国苏州市工业园区钟园路728号

法定代表人：王兰凤

联系人：杨晨

电话：0512-69868373

传真：0512-69868370

客服电话：96067

公司网址：www.suzhoubank.com

(14) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路13号

办公地址：广西南宁市滨湖路46号国海大厦

法定代表人：张雅锋

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

联系人：牛孟宇

客户服务电话：95563

公司网址：www.ghzq.com.cn

(15) 中信建投证券股份有限公司



注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号

法定代表人：王常青

客户服务电话：400-8888-108

公司网址：www.csc108.com

(16) 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

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：万建华

客户服务电话：400-8888-666

公司网址：www.gtja.com

(17) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-23219100

联系人：李笑鸣

客户服务电话：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：www.htsec.com

(18) 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

法定代表人：陈有安

客户服务电话：400-888-8888

电话：010-66568430

联系人：田薇

公司网址：www.chinastock.com.cn

(19) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

客户服务电话：95562

业务联系电话：021-38162212

业务联系人：黄英

公司网址：www.xyq.com.cn

(20) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路171号

法定代表人：储晓明

电话：021-54033888

客户服务电话：95523、4008895523

联系人：邓寒冰

公司网址：www.sywg.com

(21) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943666

传真：0755-82943636

联系人：林生迎

客户服务电话：95565、400-8888-111

公司网址：www.newone.com.cn

(22) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省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

电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：陈忠

客户服务电话：95558

公司网址：www.cs.ecitic.com

(23) 齐鲁证券有限公司

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：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889357

客户服务电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

(24) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：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：400-600-0686

公司网址：www.nesc.cn

(25) 山西证券股份有限公司

注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

联系电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

客户服务电话：400-666-1618、95573

公司网址：www.i618.com.cn

(26) 财富证券有限责任公司

地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层

法定代表人：孙智勇

电话：0731-4403319

传真：0731-4403439

联系人：郭磊

客户服务电话：0731-4403340

公司网址：www.cfzq.com

(27) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层

法定代表人：林义相

传真：010-66045521

客户服务电话：010-66045678

联系人：林爽

联系电话：010-66045608

公司网址：www.txsec.com

天相基金网网站：www.jjm.com.cn

(28) 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

法人代表：张华东

联系电话：025-83364032

联系人：徐翔

传真：025-83320066

客户服务电话：400-828-5888

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

(29) 中信证券(浙江)证券有限责任公司

住所: 浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

办公地址: 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: 王霏霏

联系电话: 0571-8711250

传真: 0571-85783771

客户服务电话: 95548

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

(30) 华泰证券股份有限公司

地址: 江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人: 吴万善

电话: 025-83290979

传真: 025-51863323

联系人: 万鸣

客户服务电话: 95597

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

(31) 安信证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址: 深圳市福田区深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人: 牛冠兴

联系人: 陈剑虹

电话: 0755-82825551

传真: 0755-82558355

客户服务电话: 400-8001-001

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

(32) 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

通讯地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

电话：021-22169999

传真：021-22169134

联系人：刘晨、李芳芳

客户服务电话：10108998、400-888-8788、95525

公司网址：www.ebscn.com

(33) 江海证券有限公司

注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

通讯地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

电话：0451-85863696

传真：0451-82287211

联系人：张宇宏

客户服务电话：400-666-2288

公司网址：www.jhzq.com.cn

(34) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

联系人：齐晓燕

客户服务电话：95536

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

(35) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

客户服务热线：95579 或 4008-888-999

客户服务网站：[www.95579.com](http://www.95579.com)

(36) 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（1507-1510室）

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户服务热线：95548

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

(37) 财富里昂证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼

法定代表人：罗浩

电话：021-38784818

传真：021-68775878

联系人：倪丹

客户服务电话：021-68777877

公司网址：[www.cf-clsa.com](http://www.cf-clsa.com)

(38) 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  
客服电话：400-089-1289  
公司网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(39) 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  
法定代表人：其实  
客户服务电话：400-1818-188  
公司网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(40) 杭州数米基金销售有限公司

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼  
法定代表人：陈柏青  
客户服务电话：4000-766-123  
公司网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(41) 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  
法定代表人：杨文斌  
客户服务电话：400-700-9665  
公司网址：[www.howbuy.com](http://www.howbuy.com) 及 [www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(42) 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  
法定代表人：汪静波  
客户服务电话：400-821-5399  
公司网址：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(43) 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  
客户服务电话：4006-788-887



公司网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(44) 北京展恒基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区德胜门外华严北里2号民建大厦6层

法定代表人：闫振杰

客户服务电话：400-888-6661

公司网址：[www.myfp.cn](http://www.myfp.cn) 及 [www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(45) 万银财富(北京)基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201

法定代表人：李招弟

客户服务电话：400-808-0069

公司网址：[www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

基金管理人可根据有关法律法规规定，增加其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

(二) 注册登记机构

名称：国海富兰克林基金管理有限公司

注册地址：广西南宁市西乡塘区总部路1号中国—东盟科技企业孵化基地一期C-6栋二层

办公地址：上海浦东世纪大道8号上海国金中心二期9层

法定代表人：吴显玲

电话：021-3855 5601

联系人：董卫军

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室

办公地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室

负责人：廖海

联系电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：廖海

经办律师：刘佳、张兰

#### （四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6楼

办公地址：上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：刘颖

经办注册会计师：薛竞、刘颖

#### 四、基金名称

富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金

#### 五、基金的类型

混合型开放式证券投资基金

#### 六、基金的投资目标

本基金通过积极进行资产配置和灵活运用多种投资策略,并通过深入挖掘和把握市场投资机会来确定本基金的投资焦点,同时合理控制组合风险,力争获取较高的绝对回报。

#### 七、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票等权益类证券投资比例为基金资产的 0%—95%，其中权证投资比例不得超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具、现金、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产的 5%，其中，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

## 八、基金的投资策略

### （一）资产配置策略

本基金贯彻“自上而下”的资产配置策略，通过对宏观经济、国家政策、证券市场流动性、大类资产相对收益特征等因素的综合分析，在遵守大类资产投资比例限制的前提下进行积极的资产配置，对基金组合中股票、债券、短期金融工具的配置比例进行调整和优化，平衡投资组合的风险与收益。本基金在进行资产配置时，重点考察宏观经济状况、国家政策、资金流动性、资产估值水平和市场因素这五个方面。

1、宏观经济状况：重点关注反映国家经济增长情况及通胀水平的宏观经济指标、工业企业经营情况、上市公司盈利增长情况等；

2、国家政策：本基金将重点分析国内外的财政政策、货币政策和资本市场政策，比如国家产业政策、信贷政策、利率政策、汇率政策以及与资本市场相关的股权制度、发行制度等相关政策；

3、资金流动性：主要考察货币环境变化对利率、汇率等关键金融变量的影响，关注市场资金在各个资产市场间的流动，包括货币供应量、商业银行信贷、资金流动情况等；

4、资产估值水平：通过对各类资产的相对估值和绝对估值指标的对比分析，寻找相对的估值洼地。

5、市场因素：主要分析反映投资者情绪和市场动量特征等方面的指标来判断未来市场的变化趋势。

本基金通过对上述指标的深入分析和综合评估，确定各类资产的配置时机和配置比例。

在预期股票市场处于高风险区域或预期股票市场趋于下跌时，本基金将大幅减少股票投资比例，而主要投资于债券市场，以回避股票市场下跌的系统性风险，避免组合损失，从而实现组合的稳健增值。

## （二）股票投资策略

本基金所关注的投资焦点将从宏观经济、政策制度、行业发展前景及地位、公司治理结构和管理层评价、核心竞争力、盈利能力和估值等多个角度进行挖掘。

### 1、宏观经济

宏观经济角度主要是从宏观经济发展状况、经济周期、全球产业变迁轨迹、通货膨胀状况以及投资者对宏观经济的预期等角度进行观察和研究。宏观经济是中长期投资焦点的大背景，是进行投资焦点挖掘的重要考量因素。

### 2、政策制度

中国经济在发展过程中呈现出较明显的政策驱动性特征，受益于财政支持、政策倾斜等利好政策的行业和企业将获得更高的增长速度，政策制度倾向也将是投资焦点挖掘的指引之一。

### 3、行业发展前景及地位

公司所在行业发展趋势良好，具有良好的行业成长性；公司在行业中处于领先地位，或者在生产、技术、市场等一个或多个方面具有行业内领先地位，并在短时间内难以被行业内的其他竞争对手超越；公司在未来的发展中，在行业或者细分行业中的地位预期会有较大的上升。

### 4、公司治理结构和管理层评价

清晰、合理公司治理是公司不断良性发展的基础。从股权结构的合理性、信息披露的质量、激励机制的有效性、关联交易的公允性、公司的管理层和股东的利益是否协调和平衡、公司是否具有清晰的发展战略等方面，对公司治理水平进行综合评估。

公司管理层的素质和能力是决定公司能否良性发展、不断创造领先优势的关键因素。对公司管理团队进行评价，主要考察其过往业绩、诚信记录、经营战略规划和商业计划执行能力等。

### 5、核心竞争力

考察一个公司是否具有核心竞争力，主要分析公司是否具有核心技术和创新能力（如专利、商标等知识产权），提供的产品（或服务）是否具有较高的技术壁垒，是否具有良好的销售网络、市场品牌或垄断资源等，是否具有领先的经营模式等。

### 6、盈利能力

结合公司所处行业的特点和发展趋势、公司背景，从财务结构、资产质量、业务增长、利润水平、现金流特征等方面考察公司的盈利能力，专注于具有行业领先优势、资产质量良

好、盈利能力较强、盈利增长具有可持续性的上市公司。

## 7、估值

企业的估值水平在一定程度上反应了其未来成长性以及当前投资的安全性。估值合理将是本基金选股的一个重要条件。本基金通过评估公司相对市场和行业的相对投资价值，选择目前估值水平明显较低或估值合理的上市公司。

### （三）债券投资策略

本基金通过对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性等影响市场利率的主要因素进行深入研究，结合新券发行情况，综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略，把握债券市场投资机会，以获取稳健的投资收益。

#### 1、久期策略

本基金根据对市场利率的趋势预期调整债券组合的久期，即预期利率将下降时，增加组合久期，以更多获取债券价格上升带来的组合收益；在预期利率将上升时，相应降低组合久期，以控制债券价格下降的风险。

#### 2、收益率曲线策略

由于债券供求、投资者偏好和市场情绪等因素，不同期限债券的市场利率变动幅度往往不一致，收益率曲线表现出非平行移动的特点。通过对不同期限债券的利率变动趋势的比较分析，本基金将在确定组合久期的前提下，采取相应的债券期限配置，以从长期、中期和短期债券的利率变化差异中获取超额收益。

#### 3、债券类属策略

由于信用水平、债券供求和市场情绪等因素，不同市场和类型债券品种的利率与基准利率的利差不断变动。通过对影响各项利差的因素进行深入分析，评估各券种的相对投资价值，调高投资价值较高的券种的比重以获取超额收益。

#### 4、信用利差策略

本基金将通过对经济周期和相关市场变化对信用利差曲线的影响，以及信用债市场容量、信用债券结构、流动性等变化趋势对信用利差曲线的影响对企业（公司）债或短期融资券等信用类品种进行综合评估，判断投资主体对信用债的需求变化，并结合不同信用等级债券在不同市场时期的利差变化及收益率曲线变化，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的投资比例及分行业的投资比例。

### （四）股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

#### （五）权证投资策略

本基金通过对权证标的证券基本面的研究，采取市场公认的权证定价模型寻求其合理的价格水平，作为基金投资权证的主要依据。

### 九、基金的业绩比较基准

$60\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 40\% \times \text{中债国债总指数收益率（全价）}$

本基金采用沪深 300 指数作为股票投资部分的业绩比较基准主要是因为沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，在上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成。该指数样本对沪深市场的覆盖度高，具有良好的市场代表性。此外，沪深 300 指数编制方法清晰透明，具有独立性和良好的市场流动性；与市场整体表现具有较高的相关度。沪深 300 指数由中证指数有限公司编制和计算，中证指数有限公司将采取一切必要措施以确保指数的精确性。

中债国债总指数由中央国债登记结算有限责任公司编制。该指数同时覆盖了上海证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的主要固定收益类证券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人有权对此基准进行调整。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并报中国证监会备案后公告，而无需召开基金份额持有人大会。

### 十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高风险收益特征的基金品种。

## 十一、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人—中国农业银行根据本基金合同规定，于2013年10月18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。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截止2013年9月30日，本报告财务资料未经审计。

### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	240,188,427.27	81.05
	其中：股票	240,188,427.27	81.05
2	固定收益投资	20,724,296.40	6.99
	其中：债券	20,724,296.40	6.99
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	10,000,000.00	3.37
	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	19,648,293.80	6.63
6	其他各项资产	5,793,744.93	1.96
7	合计	296,354,762.40	100.00

## 2. 报告期末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	-	-
C	制造业	176,918,794.49	60.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,766,860.16	2.98
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	43,073,201.36	14.65
K	房地产业	11,429,571.26	3.89
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	240,188,427.27	81.67



3. 报告期末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	000858	五 粮 液	1,449,947	26,099,046.00	8.87
2	000568	泸州老窖	1,231,823	25,991,465.30	8.84
3	002304	洋河股份	449,766	19,524,342.06	6.64
4	600104	上汽集团	1,200,000	16,236,000.00	5.52
5	002037	久联发展	1,203,455	14,068,388.95	4.78
6	601166	兴业银行	1,206,700	13,478,839.00	4.58
7	601318	中国平安	300,000	10,710,000.00	3.64
8	002563	森马服饰	420,781	10,658,382.73	3.62
9	000157	中联重科	1,850,000	10,434,000.00	3.55
10	600016	民生银行	999,952	9,559,541.12	3.25

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	20,724,296.40	7.05
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-

9	合计	20,724,296.40	7.05
---	----	---------------	------

#### 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	122088	11综艺债	54,910	5,493,196.40	1.87
2	111047	08长兴债	49,102	5,204,812.00	1.77
3	122086	11正泰债	50,000	5,075,000.00	1.73
4	112142	12格林债	39,680	3,932,288.00	1.34
5	122033	09富力债	10,000	1,019,000.00	0.35

#### 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. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1310	IF1310	-50	-36,126,000.00	-39,600.00	套保交易盈亏
公允价值变动总额合计(元)		-39600.00			
股指期货投资本期收益(元)		1657080.00			
股指期货投资本期公允价值变动(元)		-39600.00			

##### 8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定

价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

## 9. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

## 10. 投资组合报告附注

10.1 本基金本期投资的前十名证券中，无报告期内发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

10.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,234,726.23
2	应收证券清算款	11,111.11
3	应收股利	-
4	应收利息	533,533.74
5	应收申购款	14,373.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,793,744.93

### 10.4 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债。

### 10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 十二、基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。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。

截止到 2013 年 9 月 30 日基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较：

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
2013 年 5 月 7 日 - 2013 年 9 月 30 日	-2.30%	0.68%	-4.06%	0.90%	1.76%	-0.22%

### 十三、基金的费用概述

#### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的开户费用、账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

## （2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类中第 3—8 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

## （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## （五）费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

1、“重要提示”一章中更新了本招募说明书（2013 年第 1 号）所载内容截止日及有关财务数据和净值表现截止日。

2、“释义”一章中更新了《基金法》、《销售办法》释义内容。

3、“基金管理人”一章相关内容更新如下：

(一) 基金管理人

1、基金管理人概况

更新了注册地址和联系电话。

2、主要人员情况

(一) 董事会成员

- (1) 更新了董事长吴显玲女士的信息；
- (2) 更新了董事张雅锋女士、董事齐国旗先生、胡德忠先生的信息；
- (3) 更新了独立董事张忠国先生、独立董事黄湘平先生、独立董事洪荣光先生的信息。

(二) 监事会成员

- (1) 新增了监事戴刚先生的信息；
- (2) 更新了监事余天丽女士、监事李慧女士、监事张志强先生的信息；

(三) 经营管理层人员

- (1) 新增了副总经理张晓东先生、副总经理徐荔蓉先生、副总经理李彪先生的信息；
- (2) 删除了总经理李雄厚先生的信息。

(四) 督察长

- (1) 新增了督察长储丽莉女士的信息；
- (2) 删除了原督察长李彪先生的信息。

(五) 基金经理

更新了基金经理赵晓东先生的信息。

(六) 更新了投资决策委员会成员信息。

**4、“基金托管人”一章更新了基金托管人部分信息。**

**5、“相关服务机构”一章更新如下：**

一、基金份额发售机构

(一) 直销机构

更新了直销机构的注册地址。

(二) 代销机构

更新了中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、杭州联合农村商业银行股份有限公司、苏州银行股

份有限公司、国海证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、东北证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、南京证券股份有限公司、中信证券（浙江）证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、江海证券有限公司、国信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、中信万通证券有限责任公司、财富里昂证券有限责任公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、上海天天基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、万银财富（北京）基金销售有限公司这些代销机构的相关信息。

二、更新了注册登记机构的注册地址。

#### **6、“基金的募集”一章更新如下：**

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等有关法律法规及基金合同，经 2013 年 3 月 4 日中国证监会证监许可[2013]206 号文件核准募集。

本基金募集期为 2013 年 4 月 8 日至 2013 年 5 月 3 日，本次募集的净销售金额为 561,110,302.16 元人民币，认购款项在募集期间产生的银行利息共计 89,923.94 元人民币。

本次募集有效认购总户数为 8,262 户，按照每份基金份额 1 元人民币计算，本基金在募集期募集的有效认购份额为 561,110,302.16 份，利息结转的基金份额为 89,923.94 份，两项合计共 561,200,226.10 份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。

#### **7、“基金合同的生效”一章更新如下：**

##### **(1) 基金合同的生效**

经中国证券监督管理委员会核准，本基金的基金合同于 2013 年 5 月 7 日生效。

##### **(2) 基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模**

基金合同生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。

法律法规另有规定时，从其规定。

**8、“基金投资”一章中，更新了最近一期投资组合的内容，内容更新到 2013 年 9 月 30 日。**

9、“基金的业绩”一章中，更新了基金合同生效以来至 2013 年 9 月 30 日的本基金投资业绩。

10、“托管协议摘要”一章中更新了基金管理人的注册地址。

11、“其它应披露事项”一章更新了自上次招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告。

国海富兰克林基金管理有限公司

2013 年 12 月 21 日