

# 富兰克林国海强化收益债券型证券投资 基金

## 更新招募说明书(摘要) (2011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：中国银行股份有限公司

### 【重要提示】

富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2008 年 8 月 15 日证监基金字【2008】1049 号文核准募集，本基金的基金合同于 2008 年 10 月 24 日生效。本基金自 2008 年 12 月 18 日起新增 C 类收费模式。

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。

本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据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 2011 年 4 月 24 日，有关财务数据和净值表现截

止日为2011年3月31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：广西南宁市琅东滨湖路46号

办公地址：上海浦东富城路99号震旦国际大楼18楼

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：陈明月

联系电话：021-3855 5600

股权结构：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经理，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。

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，经济师。历任广西南方商业集团公司董事长兼总经理、党总支书记，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处长、副主任，国海富兰克林基金管理有限公司董事长等职。现任广西投资集团有限公司副总经理、国海证券有限责任公司董事长。

董事温昌伟先生，中共党员，大学本科学历，高级经济师。历任广西梧州大酒店总经理，梧州地区电业公司总经理。现任广西桂东电力股份有限公司董事长兼总裁。

董事梁国坚先生，大学本科学历。历任广西梧州远东美容保健用品有限公司董事长兼总经理，广西索芙特有限公司董事长。现任广西索芙特股份有限公司董事长兼总经理。

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。

董事金哲非女士，中国科技大学计算机科学学士和澳大利亚国立大学博士，注册金融分析师，金融风险管理师。历任澳大利亚联邦科学与工业研究机构、美国哈佛大学计算机科学家，富兰克林邓普顿投资公司高级副总裁兼资产组合分析与投资风险部全球总管。现任国海富兰克林基金管理有限公司总经理。

独立董事Robert R. Williams先生，硕士。历任State Street Australia Limited，（澳洲雪梨）执行董事，State Street Asia，香港资深副总裁，State Street Corporation，（美国波士顿）副行政总裁。现任浙江网新恒天软件有限公司董事长（非执行）。

独立董事平雷先生，中共党员，大学本科学历，高级工程师。历任广西壮族自治区体改委副主任、党委书记，广西壮族自治区证券管理委员会副主任，广西壮族自治区人大财经委主任委员。现已退休。

独立董事吴真先生，硕士。历任UDI（Eisenberg Group）美国公司对华总助，UDI（Eisenberg Group）欧洲总部对华总助，中国欧美深圳进出口公司总助，索芙特股份有限公司董事副总经理。现任Green View International Resort董事总裁。

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。

监事会成员：

## 2、监事会成员

监事会主席何雅玲女士，本科学历。曾在麦坚时律师事务所，隶属摩根大通资产管理的JF资产管理有限公司工作。现任富兰克林邓普顿投资（亚洲）有限公司首席法律顾问——亚洲区。

监事李慧女士，中共党员，硕士研究生学历。历任广西证券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。现任国海证券有限责任公司稽核监察部总经理。

监事张志强先生，硕士研究生学历，特许金融分析师（CFA）。曾在美国 Enreach Technology Inc.、海通证券股份有限公司、友邦华泰基金管理有限公司工作。2007年4月加入国海富兰克林基金管理有限公司，现任首席数量分析师、风险控制部总经理和业务发展部总经理。

### 3、经营管理层人员

总经理金哲非女士，中国科技大学计算机科学学士和澳大利亚国立大学博士，注册金融分析师，金融风险管理师。历任澳大利亚联邦科学与工业研究机构、美国哈佛大学计算机科学家，富兰克林邓普顿投资公司高级副总裁兼资产组合分析与投资风险部全球总管。现任国海富兰克林基金管理有限公司总经理。

副总经理李雄厚先生，中山大学经济学硕士。历任中国工商银行深圳市分行业务发展部高级经理、宝安证券营业部负责人、上海证券业务部筹建负责人，鹏华基金管理有限公司市场部渠道销售主管，招商基金管理有限公司营销管理部总监，友邦华泰基金管理有限公司副总经理，景顺投资管理有限公司（INVESCO HK）机构业务联席总监。现任国海富兰克林基金管理有限公司副总经理。

### 4、督察长

督察长李彪先生，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期货机构监管处副处长、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。现任国海富兰克林基金管理有限公司督察长。

### 5、基金经理

#### 现任基金经理

刘怡敏女士，CFA，2003年毕业于四川大学，获金融学硕士学位。曾任富国基金管理有限公司固定收益部债券研究员，西南证券研究发展中心策略部债券研究员。现任本基金基金经理，并同时担任富兰克林国海中国收益证券投资基金基金经理。

#### 历任基金经理

无，该基金自成立以来一直由刘怡敏女士任基金经理，没有发生基金经理变更。

### 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：金哲非女士（公司总经理，兼任投资决策委员会主席）；潘江先生（基金经理）；张晓东先生（基金经理）；朱国庆先生（基金经理）；徐荔蓉先生（基金经理，兼研究分析部总经理）。李彪先生（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）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

变更注册登记日期：2004年8月26日

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门负责人：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

发展概况：

1912年2月，经孙中山先生批准，中国银行正式成立。从1912年至1949年，中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。新中国成立后，中国银行长期作为国家外汇专业银行，成为我国对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。1994年，中国银行改为国有独资商业银行。2003年，中国银行启动股份制改造。2004年8月，中国银行股份有限公司挂牌成立。2006年6月、7月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。

中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港澳门台湾及31个国家和地区为客户提供全面的金融服务，主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务，通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资管理业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。

在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神、稳健经营的理念、客户至上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象。2010 年度，中国银行被 Global Finance（《环球金融》）评为 2010 年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行，被 Euromoney（《欧洲货币》）评为 2010 年度房地产业“中国最佳商业银行”，被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖，被 The Asset（《财资》）评为中国最佳贸易融资银行，被 Finance Asia（《金融亚洲》）评为中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行，被《21 世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇，中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展，向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

## （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行于 1998 年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工 110 余人，其中，90%以上的员工具备本科以上学历。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII 资产、QDII 资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务。2010 年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元，居同业前列。

## （三）证券投资基金托管情况

截止 2011 年 3 月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成 2020 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深 300 指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证 100 指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股

票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证 100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票 (LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行业股票型、南方高增长股票 (LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证 180 金融交易型开放式指数、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接、工银全球股票 (QDII)、嘉实海外中国股票 (QDII)、银华全球优选 (QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型 (QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型 (QDII)、信诚金砖四国积极配置 (QDII)、海富通大中华精选股票型 (QDII)、招商标普金砖四国指数 (LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选 (QDII)、大成标普 500 等权重指数 (QDII)、长信标普 100 等权重指数 (QDII) 等 107 只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

#### **(四) 托管业务的内部控制制度**

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部

信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

最近一年内，中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

#### **（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序**

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

### **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：广西南宁市琅东滨湖路46号

办公地址：上海浦东富城路99号震旦国际大楼18楼

法定代表人：吴显玲

联系人：白雨杉

联系电话：021-3855 5678

##### **2、代销机构：**

#### **（1）富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金[A类]代销机构：**

##### **1) 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：肖钢

客户服务电话：95566

公司网站：www.boc.cn

##### **2) 中国农业银行股份有限公司**



住所：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：项俊波  
传真：010-85109219  
客户服务电话：95599  
公司网址：www.abchina.com

3) 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  
法定代表人：姜建清  
电话：010-66107900  
传真：010-66107914  
客户服务电话：95588  
联系人：田耕  
公司网站：www.icbc.com.cn

4) 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(长安兴融中心)  
法定代表人：郭树清  
电话：010-66275654  
传真：010-66275654  
联系人：王琳  
客户服务电话：95533  
网址：www.ccb.com

5) 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：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

6) 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

网址：www.cmbchina.com

7) 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

法定代表人：孔丹

电话：010-6555 7083

传真：010-6555 0827

联系人：丰靖

客户服务电话：95558

公司网址：bank.ecitic.com

8) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

电话：010-85238667

传真：010-85238680

联系人：郑鹏

客户服务电话：95577

公司网站：www.hxb.com.cn

9) 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

客户服务电话：95568

传真：010-57092611

联系人：吴海鹏、董云巍

公司网址：www.cmbc.com.cn

10) 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

联系人：李伟

电话：010-68098778

传真：010-68560661

客户服务电话：95595

网址：www.cebbank.com

11) 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：徐伟、虞谷云

客户服务电话：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

12) 宁波银行股份有限公司  
住所：宁波市江东区中山东路 294 号  
法定代表人：陆华裕  
电话：021-63586210  
传真：021-63586215  
联系人：胡技勋  
客户服务电话：96528（上海地区 962528）  
网址：www.nbcb.com.cn

13) 东莞银行股份有限公司  
注册地址：东莞市运河东一路 193 号  
法定代表人：廖玉林  
电话：0769-22119061  
传真：0769-22117730  
联系人：胡昱  
客户服务电话：0769-96228  
网址：www.dongguanbank.cn

14) 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  
网址：www.cbhb.com.cn

15) 国海证券有限责任公司  
注册地址：广西南宁市滨湖路 46 号国海大厦

法定代表人：张雅锋

电话：0755-83707413

传真：0755-83700205

联系人：武斌

客户服务电话：400-888-8100（全国）、96100（广西）

公司网站：www.ghzq.com.cn

16) 中信建投证券有限责任公司

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：张佑君

客户服务电话：400-8888-108

公司网站：www.csc108.com

17) 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

18) 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

19) 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：顾伟国

客户服务电话：400-888-8888

电话：010-66568888

联系人：田薇

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

20) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路99号标力大厦

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：400-8888-123

业务联系电话：021-38565785

业务联系人：谢高得

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

21) 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：丁国荣

电话：021-54033888

客户服务电话：021-962505

联系人：邓寒冰

网址：[www.sw2000.com.cn](http://www.sw2000.com.cn)

22) 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

公司网站：www.newone.com.cn

23) 华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、

18A、24A、25A、26A

法定代表人：马昭明

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

客户服务电话：95513

联系人：盛宗凌

网址：www.lhzq.com

24) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

法定代表人：王东明

电话：010-84683893

传真：010-84865560

联系人：陈忠

客户服务电话：95558

公司网址：www.cs.ecitic.com

25) 齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路20518号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-81283938

传真：0531-81283900

客户服务电话：95538

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

26) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路183号大都会广场43楼

办公地址：广东广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼

法定代表人：王志伟

电话：020-87555888

客户服务电话：95575

开放式基金业务传真：020-87556789

联系人：黄岚

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

27) 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：潘锴

电话：0431-85096709

客户服务电话：400-600-0686

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

28) 山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686703

传真：0351-8686619

客户服务电话：400-666-1618

联系人：张治国

网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)



- 29) 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：周晖  
电话：0731-4403319  
传真：0731-4403439  
联系人：郭磊  
客户服务电话：0731-4403319  
网址：www.cfzq.com
- 30) 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：010-66045500  
客户服务电话：010-66045678  
联系人：潘鸿  
联系人电话：010-66045446  
公司网站：www.txsec.com、www.txjijin.com
- 31) 南京证券有限责任公司  
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  
公司网站：www.njzq.com.cn
- 32) 中信金通证券有限责任公司

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：刘军

联系人：俞会亮

联系电话：0571-85776115

传真：0571-85783771

客户服务电话：0571-96598

网址：[www.96598.com.cn](http://www.96598.com.cn)、[www.bigsun.com.cn](http://www.bigsun.com.cn)

33) 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

联系人：万鸣

客户咨询电话：025-84579897

客户服务电话：95597

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

34) 湘财证券有限责任公司

地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

法定代表人：林俊波

电话：021-68634518

传真：021-68865680

联系人：钟康莺

联系人电话：021-68634518-8503

客户服务电话：400-888-1551

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

35) 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：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

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

公司网站：www.essence.com.cn

36) 中航证券有限公司

注册地址：南昌市抚河北路291号

通讯地址：南昌市抚河北路291号

法定代表人：杜航

传真：0791-6789414

联系电话：0791-6768763

联系人：余雅娜

客户服务电话：400-8866-567

公司网站：www.avicsec.com

37) 国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路179号

通讯地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志

电话：0551-2246273

传真：0551-2272100

联系人：陈琳琳

客户服务电话：400-8888-777或95578、安徽省内客服电话：96888

公司网站：www.gyzq.com.cn

38) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号

通讯地址：上海市黄浦区西藏中路336号

法定代表人：郁忠民

联系人：张瑾

联系电话：021-53519888

客户服务电话：021-962518，4008-918-918（全国）

公司网站：www.962518.com

39) 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

公司网站：www.ebscn.com

40) 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：0451-82336863

传真：0451-82287211

联系人：徐世旺

客户服务电话：400-666-2288

公司网站：www.jhzq.com.cn

41) 东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

法定代表人：朱科敏

联系人：李涛

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

客户服务电话：400-888-8588

公司网络地址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

42) 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 1010 号国际信托大厦 9 楼

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

传真：0755-82133302

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)

43) 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

法定代表人：冯戎

电话：010-88085338

传真：010-88085240

联系人：李巍

客户服务电话：4008-000-562（全国）

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

44) 华宝证券有限责任公司

注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

法定代表人：陈林

电话：021-50122222

传真：021-50122200

联系人：陈康菲

客户咨询电话：400-820-9898

公司网站：www.cnhbstock.com

45) 广发华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路新天地大厦 7、8 层

法定代表人：黄金琳

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

联系人：张腾

客户服务电话：96326（福建省外加拨 0591）

公司网址：www.gfhfzq.com.cn

(2) 富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金[C类]代销机构：

1) 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：肖钢

客户服务电话：95566

公司网站：www.boc.cn

2) 中国农业银行股份有限公司

住所：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：项俊波

传真：010-85109219

客户服务电话：95599

公司网址：www.abchina.com

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(长安兴融中心)

法定代表人：郭树清

电话：010-66275654

传真：010-66275654

联系人：王琳

客户服务电话：95533

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：胡怀邦

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

5) 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

法定代表人：孔丹

电话：010-6555 7083

传真：010-6555 0827

联系人：丰靖

客户服务电话：95558

公司网址：bank.ecitic.com

6) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

电话：010-85238667

传真：010-85238680

联系人：郑鹏

客户服务电话：95577

公司网站：www.hxb.com.cn

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

客户服务电话：95568

传真：010-57092611

联系人：吴海鹏、董云巍

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：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：唐双宁

联系人：李伟

电话：010-68098778

传真：010-68560661

客户服务电话：95595

网址：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：徐伟、虞谷云  
客户服务电话：95528  
公司网站：www.spdb.com.cn
- 10) 宁波银行股份有限公司  
住所：宁波市江东区中山东路 294 号  
法定代表人：陆华裕  
电话：021-63586210  
传真：021-63586215  
联系人：胡技勋  
客户服务电话：96528（上海地区 962528）  
网址：www.nbcb.com.cn
- 11) 东莞银行股份有限公司  
注册地址：东莞市运河东一路 193 号  
法定代表人：廖玉林  
电话：0769-22119061  
传真：0769-22117730  
联系人：胡昱  
客户服务电话：0769-96228  
网址：www.dongguanbank.cn
- 12) 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

网址：www.cbhb.com.cn

13) 国海证券有限责任公司

注册地址：广西南宁市滨湖路 46 号国海大厦

法定代表人：张雅锋

电话：0755-83707413

传真：0755-83700205

联系人：武斌

客户服务电话：400-888-8100（全国）、96100（广西）

公司网站：www.ghzq.com.cn

14) 中信建投证券有限责任公司

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：张佑君

客户服务电话：400-8888-108

公司网站：www.csc108.com

15) 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

- 16) 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
- 17) 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：顾伟国  
客户服务电话：400-888-8888  
电话：010-66568888  
联系人：田薇  
公司网址：www.chinastock.com.cn
- 18) 兴业证券股份有限公司  
注册地址：福州市湖东路99号标力大厦  
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：400-8888-123  
业务联系电话：021-38565785  
业务联系人：谢高得  
公司网址：www.xyzq.com.cn
- 19) 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

公司网站：www.newone.com.cn

20) 华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A

法定代表人：马昭明

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

客户服务电话：95513

联系人：盛宗凌

网址：www.lhzq.com

21) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

法定代表人：王东明

电话：010-84683893

传真：010-84865560

联系人：陈忠

客户服务电话：95558

公司网址：www.cs.ecitic.com

22) 齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路20518号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-81283938

传真：0531-81283900

客户服务电话：95538

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

23) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路183号大都会广场43楼

办公地址：广东广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼

法定代表人：王志伟

电话：020-87555888

客户服务电话：95575

开放式基金业务传真：020-87556789

联系人：黄岚

网址： [www.gf.com.cn](http://www.gf.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：潘锴

电话：0431-85096709

客户服务电话：400-600-0686

网址： [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

25) 山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686703

传真：0351-8686619

客户服务电话：400-666-1618

联系人：张治国

网址: [www.i618.com.cn](http://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: 周晖

电话: 0731-4403319

传真: 0731-4403439

联系人: 郭磊

客户服务电话: 0731-4403319

网址: [www.cfzq.com](http://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: 010-66045500

客户服务电话: 010-66045678

联系人: 潘鸿

联系人电话: 010-66045446

公司网站: [www.txsec.com](http://www.txsec.com)、[www.txjijin.com](http://www.txjijin.com)

28) 中信金通证券有限责任公司

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: 刘军

联系人: 俞会亮

联系电话: 0571-85776115

传真: 0571-85783771

客户服务电话: 0571-96598

网址: [www.96598.com.cn](http://www.96598.com.cn)、[www.bigsun.com.cn](http://www.bigsun.com.cn)

29) 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

联系人：万鸣

客户咨询电话：025-84579897

客户服务电话：95597

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

30) 湘财证券有限责任公司

地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

法定代表人：林俊波

电话：021-68634518

传真：021-68865680

联系人：钟康莺

联系人电话：021-68634518-8503

客户服务电话：400-888-1551

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

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：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

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

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

32) 国元证券股份有限公司

注册地址: 安徽省合肥市寿春路179号

通讯地址: 安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人: 凤良志

电话: 0551-2246273

传真: 0551-2272100

联系人: 陈琳琳

客户服务电话: 400-8888-777或95578、安徽省内客服电话: 96888

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

33) 上海证券有限责任公司

注册地址: 上海市黄浦区西藏中路336号

通讯地址: 上海市黄浦区西藏中路336号

法定代表人: 郁忠民

联系人: 张瑾

联系电话: 021-53519888

客户服务电话: 021-962518, 4008-918-918 (全国)

公司网站: [www.962518.com](http://www.962518.com)

34) 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



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

35) 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: 0451-82336863

传真: 0451-82287211

联系人: 徐世旺

客户服务电话: 400-666-2288

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

36) 东海证券有限责任公司

注册地址: 江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

办公地址: 江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

法定代表人: 朱科敏

联系人: 李涛

电话: 0519-88157761

传真: 0519-88157761

客户服务电话: 400-888-8588

公司网络地址: [www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

37) 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 1010 号国际信托大厦 9 楼

法定代表人: 何如

电话: 0755-82130833

传真: 0755-82133302

联系人: 齐晓燕

客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

38) 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

法定代表人：冯戎

电话：010-88085338

传真：010-88085240

联系人：李巍

客户服务电话：4008-000-562（全国）

公司网站：www.hysec.com

39) 华宝证券有限责任公司

注册地址：中国上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

法定代表人：陈林

电话：021-50122222

传真：021-50122200

联系人：陈康菲

客户咨询电话：400-820-9898

公司网站：www.cnhbstock.com

40) 广发华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路新天地大厦 7、8 层

法定代表人：黄金琳

电话：0591-87383623

传真：0591-87383610

联系人：张腾

客户服务电话：96326（福建省外加拨 0591）

公司网址：www.gfhfzq.com.cn

(二) 注册登记机构

国海富兰克林基金管理有限公司

注册地址：广西南宁市琅东滨湖路46号

法定代表人：吴显玲

电话：(021) 3855 5601

传真：(021) 68880981

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：廖海、黎明

(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：上海市浦东新区东昌路568号

办公地址：上海湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：杨绍信

电话：021-6123 8888

传真：021-6123 8800

经办注册会计师：薛竞 单峰

**四、基金名称**

富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金

**五、基金的类型**

## 债券型开放式证券投资基金

### 六、基金的投资目标

通过主动的资产管理，在严格控制风险、保证资产充分流动性的基础上，力求为投资者创造持续稳定的投资回报。

### 七、基金的投资范围

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券、股票、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金主要投资于国债、金融债、央行票据、信用等级为投资级以上的企业债、公司债和短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益证券品种。本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金也可投资于非固定收益类金融工具。本基金可以参与一级市场新股申购，也可以直接投资于二级市场的股票。本基金不直接通过二级市场买入权证，可持有股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非债券类品种。本基金投资于固定收益类资产以外的其它资产（包括股票、权证等）的比例不超过基金资产的 20%。

根据未来法律法规或监管机构相关政策的变动，本基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整上述投资比例并投资于法律法规或监管机构允许投资的其他金融产品。

### 八、基金的投资策略

#### （一）固定收益类品种投资策略

债券投资组合的回报主要来自于组合的久期管理，识别收益率曲线中价值低估的部分以及各类债券中价值低估的种类。本基金将采取积极主动的投资策略，以中长期利率趋势分析为主，结合经济周期、宏观经济运行中的价格指数、资金供求分析、货币政策、财政政策研判及收益率曲线分析，在保证流动性和风险可控的前提下，实施积极的债券投资组合管理。

#### （1）利率预期策略

利率变化是影响债券价格的最重要的因素，利率预期策略是本基金的基本投资策略。通过对宏观经济、金融政策、市场供需、市场结构变化等因素的分析，采用定性分析与定量分析相结合的方法，形成对未来利率走势的判断，并依此调整组合久期和资产配置比例。

#### （2）久期控制策略

在对利率变化方向和趋势判断的基础上，确定恰当的久期目标，合理控制利率风险。在

预期利率整体上升时，降低组合久期；在预期利率整体下降时，提高组合久期。

### (3) 期限结构配置

在决定本基金债券组合的久期后，本基金主要采用收益率曲线分析策略决定组合期限结构配置。

收益率曲线分析策略是根据收益曲线的非平行移动调整资产组合，即通过考察市场收益率曲线的动态变化及预期变化，寻求在一段时间内获得因收益率曲线形状变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益的策略。主要有三种配置方式可以选择：子弹策略是将组合各债券到期期限高度集中于收益率曲线上的某一点；哑铃策略是将到期期限集中于曲线的两端；而梯形策略则是各期限到期的债券所占的比重基本一致。

### (4) 类属资产配置策略

不同类型的债券在收益率、流动性和信用风险上存在差异，有必要将债券资产配置于不同类型的债券品种以及在不同市场上进行配置，以寻求收益性、流动性和信用风险补偿间的最佳平衡点。

在综合信用分析、流动性分析、税收及市场结构等因素分析的基础上，本基金根据对金融债、企业债等债券品种与同期限国债之间收益率利差的扩大和收窄的预期，主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例，降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例，获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

### (5) 债券品种选择策略

在以上债券资产久期、期限和类属配置的基础上，本基金根据债券市场收益率数据，运用利率模型对单个债券进行估值分析，并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋、提前偿还和赎回等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。为控制基金债券投资的信用风险，本基金投资的企业债券需经国内评估机构进行信用评估，要求其信用评级为投资级以上。如果债券获得主管机构的豁免评级，本基金根据对债券发行人的内部信用风险分析，决定是否将该债券纳入基金的投资范围。

### (6) 套利策略

在有效资产配置的基础之上，基金管理人还将采用多种投资手段，把握市场上的无风险套利机会，并利用杠杆原理以及各种衍生工具，增加盈利性，控制风险。

## (二) 动态收益增强策略

在以上债券投资策略的基础上，本基金还将根据债券市场的动态变化，采取多种灵活的策略，获取超额收益。主要包括骑乘收益率曲线策略、息差策略等。

### (1) 骑乘收益率曲线策略

骑乘收益率曲线策略是指当收益率曲线相对陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处

的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着债券期限剩余期限缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券收益率的下滑，获得资本利得收益。

## **(2) 息差策略**

息差策略是指通过不断正回购融资并持续买入债券的操作，只要回购资金成本低于债券收益率，就可以达到杠杆放大的套利目标。

本基金将根据对市场回购利率走势的判断，适当地选择杠杆比率，谨慎地实施息差策略，提高投资组合的收益水平。

## **(三) 股票投资策略**

本基金的股票投资包括股票二级市场投资和新股申购。

本基金可适当参与股票二级市场的投资，主要采用“自下而上”的投资策略，将定量的股票筛选和定性的公司深度研究相结合，精选具有稳定的现金分红能力和持续的盈利增长预期，且估值合理的优质上市公司股票。

本基金认为参与新股申购获得收益不但要求对股票上市价格进行准确判断，更重要的是对上市企业更长期投资价值的判断。因此，对上市公司进行深度的基本面研究、挖掘内在投资价值是本基金获得超额收益的主要来源之一。本基金对获配新股适时选择获配新股变现时机，以获取较好的股票变现收益。

## **(四) 可转债投资策略**

可转换债券（含可交易分离可转债）兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。可转债的选择结合其债性和股性特征，在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析，投资具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券，获取稳健的投资回报。

## **(五) 权证投资策略**

本基金不直接从二级市场买入权证，可持有股票派发或可分离交易可债券所分离的权证。

## **九、基金的投资决策流程**

严格的投资决策流程是本基金进行投资组合和控制投资风险的制度保障。本基金通过对不同层次的决策主体明确授权范围，建立完善的投资决策运作体系。投资决策委员会是本基金管理人最高的投资决策机构。

债券投资决策主要根据对宏观经济趋势的研究结论，指导对利率趋势和债券市场的判断，并据此形成投资决策。

## 1、宏观经济、利率期限结构和债券市场分析

宏观经济研究员对国内、国际经济趋势进行分析，债券研究员在此基础上对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测，并将分析和预测结果提交每月债券资产配置会议及其他会议讨论。

## 2、债券投资策略和期限配置建议

债券基金经理、宏观研究员和债券研究员经过每月债券资产配置会议对宏观经济、债券市场和利率期限结构的分析讨论，债券基金经理根据分析的结论对下阶段债券投资策略和期限配置提出建议和制定实施计划，向债券投资决策委员会提交《债券资产配置报告》。

## 3、债券投资策略和期限配置决策

投资决策委员会在听取宏观经济研究员、债券研究员的分析和预测结果后，对债券基金经理提交的《债券资产配置报告》进行审议，审议结果作为投资组合的债券投资策略和期限配置（范围）决策。

## 4、债券选择和债券组合构建

债券基金经理依照投资决策委员会审议通过的债券投资策略、债券组合久期和期限配置决策构建债券投资组合。

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集中交易室。在构建投资组合的过程中，基金经理必须严格遵守基金合同的投资限制及其他要求。

## 5、投资指令的下达与执行及反馈

集中交易室依据具体执行债券等品种的买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理并提供建议，以便基金经理及时调整交易策略。

6、监察稽核部对债券投资运作过程中的合规性风险控制进行监督和检查，就发现的问题及时提醒债券基金经理及有关领导。

7、投资风险管理和业绩评估会议：由公司总经理、投资总监、研究主管和风险管理经理组成投资风险管理与业绩评估小组。该小组定期或不定期召开投资风险管理和业绩评估会议，风险管理经理提交最新的投资风险和业绩评估报告，确保所有的风险控制指标和规则均有效执行，并就潜在的风险因素进行分析和讨论，对基金的投资提出建议。风险管理经理应将投资风险和业绩评估报告，以及投资风险管理和业绩评估会议对于基金投资的建议提交投资决策委员会。

8、债券基金经理根据风险管理和业绩评估报告，以及投资风险管理与业绩评估小组的建议，结合最新信息和研究结果做出投资组合的适当调整。

## 十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中债总指数（全价）

中债总指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，能够反映债券市场总体走势，具有较强的代表性、权威性，并得到投资者的广泛认同，适合作为本基金的业绩比较基准。

如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。

## 十一、基金的风险收益特征

本基金属债券型证券投资基金，为证券投资基金中的较低风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益低于混合型基金，高于货币市场基金。

## 十二、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银行股份有限公司根据本基金合同的规定，已于 2011 年 4 月 19 日复核了本投资组合报告的内容。

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，投资者在作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 2011 年 3 月 31 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	13,234,231.55	9.24
	其中：股票	13,234,231.55	9.24
2	固定收益投资	120,062,094.69	83.84
	其中：债券	120,062,094.69	83.84



	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	3,608,999.02	2.52
6	其他资产	6,292,755.09	4.39
7	合计	143,198,080.35	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	7,870,963.75	5.73
B	采掘业	-	-
C	制造业	2,858,535.00	2.08
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	26,440.00	0.02
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	2,817,000.00	2.05
C8	医药、生物制品	15095.00	0.01
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	2,504,732.80	1.82
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-

L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	13,234,231.55	9.63

### 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	601118	海南橡胶	637,325	7,870,963.75	5.73
2	600690	青岛海尔	100,000	2,817,000.00	2.05
3	000061	农产品	149,984	2,504,732.80	1.82
4	300198	纳川股份	500	15,500.00	0.01
5	300199	翰宇药业	500	15,095.00	0.01
6	300200	高盟新材	500	10,940.00	0.01
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

### 4. 报告期末按券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	14,547,036.00	10.58
2	央行票据	19,862,000.00	14.45
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	55,081,782.67	40.08
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	30,571,276.02	22.24
7	其他	-	-
8	合计	120,062,094.69	87.36

### 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	1101013	11央票13	200,000	19,862,000.00	14.45
2	110015	石化转债	107,100	11,568,942.00	8.42
3	113002	工行转债	94,400	11,305,344.00	8.23
4	1180056	11长交债	100,000	10,032,000.00	7.30
5	010112	21国债(12)	98,000	9,807,840.00	7.14

#### 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。

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。

3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	44,871.99
2	应收证券清算款	4,388,104.38
3	应收股利	-
4	应收利息	1,147,793.46
5	应收申购款	711,985.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,292,755.09

4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值
----	------	------	---------	---------

				比例(%)
1	113002	工行转债	11,305,344.00	8.23
2	110003	新钢转债	4,693,798.00	3.42
3	110009	双良转债	1,180,200.00	0.86
4	110007	博汇转债	777,455.00	0.57
5	125731	美丰转债	621,888.20	0.45

5) 报告期末前十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	601118	海南橡胶	7,870,963.75	5.73	网下新股IPO锁定期
2	300198	纳川股份	15,500.00	0.01	新股未上市
3	300199	翰宇药业	15,095.00	0.01	新股未上市
4	300200	高盟新材	10,940.00	0.01	新股未上市

### 十三、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 2011 年 3 月 31 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：

(一) 富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金[A 类]

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
2008 年 10 月 24 日—2008 年 12 月 31 日	3.25%	0.17%	2.93%	0.11%	0.32%	0.06%
2009 年 1 月 1 日—2009 年 12 月 31 日	2.23%	0.19%	-0.84%	0.06%	3.07%	0.13%
2010 年 1 月 1 日—2010 年 12 月 31 日	3.95%	0.20%	-0.87%	0.10%	4.82%	0.10%
2011 年 1 月 1 日—	1.92%	0.38%	0.08%	0.10%	1.84%	0.28%

2011年3月31日						
2008年10月24日 — 2011年3月31日	11.82%	0.21%	1.26%	0.09%	10.56%	0.12%

(二) 富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金[C类]

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
2008年12月18日 — 2008年12月31日	0.13%	0.10%	0.51%	0.10%	-0.38%	0.00%
2009年1月1日— 2009年12月31日	2.02%	0.19%	-0.84%	0.06%	2.86%	0.13%
2010年1月1日— 2010年12月31日	3.84%	0.20%	-0.87%	0.10%	4.71%	0.10%
2011年1月1日— 2011年3月31日	1.84%	0.38%	0.08%	0.10%	1.76%	0.28%
2008年12月18日 — 2011年3月31日	8.03%	0.22%	-1.12%	0.09%	9.15%	0.13%

#### 十四、基金的费用概述

(一) 基金运作费用

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) 销售服务费；
- (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) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- (7) 基金的证券交易费用；
- (8) 基金财产拨划支付的银行费用；
- (9) 按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

2、上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照合理的价格确定，法律法

规另有规定时从其规定。

### 3、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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 0.6%

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 10 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，支付日期顺延。

#### (2) 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.2%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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，经基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财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) 销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费年费率为 0.3%。本基金销售服务费将专门用于本基金 C 类的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该费用的列支情况作专项说明。

在通常情况下，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.3% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$

H 为每日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，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 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管理人收到后按照与销售机构的销售协议的约定分别支付给各销售机构。

(4) 上述 1 中 (4) 到 (7) 项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定, 按费用支出金额支付, 列入或摊入当期基金费用。

#### 4、不列入基金费用的项目

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。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付, 基金收取认购费的, 可以从认购费中列支。

5、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率, 无须召开基金份额持有人大会。调高基金管理费率和基金托管费率, 须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前两个工作日在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

### (二) 基金销售费用

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“第六部分 基金的募集”中“七、认购方式与费率结构”中的相关规定。本基金申购费、赎回费、转换费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”中的“六、申购和赎回的价格、费用及其用途”和“十一、基金转换”中的相关规定。

### (三) 基金税收

基金和基金份额持有人根据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

### 1、在“重要提示”中更新了如下内容:

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2011 年 4 月 24 日, 有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 3 月 31 日(财务数据未经审计)。

### 2、“基金管理人”章节相关内容更改如下:

#### 二、主要人员情况

##### 1、董事会成员

更新副董事长信息。

##### 3、经营管理层人员

更新副总经理信息。

## 5、基金经理

更新基金经理信息。

3、对“基金托管人”一章部分信息做了更新。

4、在“相关服务机构”一章中变更如下：

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

联系人：白雨杉

#### 2、代销机构

(1) 富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金[A类]增加了中信证券股份有限公司的信息，并更新了以下代销机构信息：中国建设银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司和光大证券股份有限公司。

(2) 富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金[C类]增加了中信证券股份有限公司的信息，并更新了以下代销机构信息：中国建设银行股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司和光大证券股份有限公司。

5、在“基金份额的申购与赎回”一章中，更新了本基金申购与赎回的数额限制的内容。

6、更新了“基金的投资”一章本基金最近一期投资组合的内容，内容更新到2011年3月31日。

7、更新了“基金的业绩”一章，补充说明基金合同生效以来至2011年3月31日末的本基金投资业绩。

8、更新了“其他应披露事项”一章。

国海富兰克林基金管理有限公司

2011年6月8日