

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）

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】

富兰克林国海焦点驱动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2016年11月7日，有关财务数据和净值表现截止日为2016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：施颖楠

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：

董事长麦敬恩（Gregory E. McGowan）先生，硕士学位以及法学博士学位。在加入富兰克林邓普顿投资集团之前，麦敬恩先生是美国证券交易委员会的资深律师。麦敬恩先生于 1986 年加入富兰克林邓普顿投资集团，担任 Templeton Global Advisors Limited（巴哈马）执行副总裁。曾任 Templeton International Inc. 执行副总裁和多个富兰克林邓普顿公司董事，包括 Templeton Investment Counsel, LLC, Franklin Templeton Management Luxembourg S.A.（卢森堡），富兰克林邓普顿投资（亚洲）有限公司（香港），Templeton Asset Management Ltd.（新加坡），Franklin Templeton Holding Limited（毛里求斯），Franklin Templeton Services Limited（爱尔兰）。现任富兰克林邓普顿投资集团高级战略顾问，国海富兰克林基金管理有限公司股东代表、董事长，国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事。

副董事长吴显玲女士，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、董事长、国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事长。现任国海富兰克林基金管理有限公司副董事长兼总经理，兼任国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事长、代为履行总经理职责，同时兼任国海富兰克林投资管理（上海）有限公司执行董

事兼总经理。

董事何春梅女士，中共党员，工程硕士。历任广西壮族自治区政府办公厅第五秘书处科员、副主任科员，广西开发投资有限责任公司融资部副经理、财务部副经理、经理、总经理，广西投资集团有限公司总裁助理兼办公室主任，国海证券有限责任公司监事，广西壮族自治区金融工作办公室副主任、党组成员、机关党委书记，广西北部湾股权交易所股份有限公司董事。现任广西投资集团有限公司党委副书记，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，国海富兰克林基金管理有限公司董事。

董事阮博文（William Y. Yun）先生，工商管理硕士，CFA。阮先生担任 Franklin Resources, Inc. 的管理人员，亦是该公司的投资管理和风险管理委员会成员。他也是 Fiduciary Trust Company International（「Fiduciary Trust」）的董事会成员，于 1992 年加入 Fiduciary Trust 担任基金经理 8 年，之后成为执行副总裁，负责 Fiduciary Trust 的全球权益类部门，并在 2000 年至 2005 年期间担任 Fiduciary Trust 的总裁。他于 2002 年又担任 Franklin Templeton Institutional 的总裁，负责富兰克林邓普顿全球业务发展团队的机构业务，其职责还包括负责富兰克林邓普顿养老金固定收益计划和投资固定缴款业务，以及负责 Franklin Templeton Portfolio Advisors 通过投资顾问和咨询人员为个人和机构客户提供专户管理。在 2008 年，他开始担任目前于富兰克林邓普顿投资集团的职务。现任富兰克林邓普顿投资集团执行副总裁，并负责特定和另类投资团队，同时兼任国海富兰克林基金管理有限公司和国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事。

董事胡德忠先生，中共党员，管理学博士，经济师。历任广西区人民银行计划处科员，广西证券公司国债交易部办事员，广西证券有限责任公司深圳深南中路证券营业部出市代表、清算部经理、交易部经理、总经理助理、副总经理、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裁助理兼经纪业务部总经理，国海证券有限责任公司副总裁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、常务副总裁，广西北部湾股权交易所股份有限公司董事长，国海创新资本投资管理有限公司董事。现任国海证券股份有限公司常务副总裁，广西北部湾股权交易所股份有限公司董事，国海富兰克林基金管理有限公司董事，同时兼任国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事。

董事燕文波先生，中共党员，工商管理硕士。历任君安证券有限责任公司人力资源部职员、资产管理部职员，上海浦东科创有限公司投资部经理，民生证券有限责任公司人力资源部总经理，联合证券有限责任公司人力资源部总经理、机构客户部总经理，国海证券有限责任公司总裁助理（并先后兼任总裁办公室主任和资产管理部、资本市场部、北京管理总部总经理等职务），副总裁兼北京分公司总经理，国海证券有限责任公司副总裁兼资本市场部总经理、北京分公司总经理。现任国海证券股份有限公司副总裁兼北京分公司总经理，国海富兰克林基金管理有限公司董事。

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。2000年7月加入富兰克林邓普顿投资，先后担任机构业务拓展董事、香港区销售及市场业务拓展主管、香港区总监。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，国海富兰克林基金管理有限公司董事。

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），现已退休。现任国海富兰克林基金管理有限公司独立董事。

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，国海富兰克林基金管理有限公司独立董事。

独立董事徐同女士，复旦大学经济学硕士，曾任上海普陀区政协委员。历任深圳特区证券公司交易部经理、办公室主任、深圳上证总经理，国泰证券公司总经理助理，北京证券公司副总经理，北京华远集团总经济师，国都证券公司总经济师。现任三亚财经论坛发展有限公司董事，国海富兰克林基金管理有限公司独立董事。

独立董事刘戎戎女士，MBA 商学硕士。历任麦肯锡公司商业分析员，昆仲亚洲基金合伙人，Vision Investment Management (Asia) Limited 董事总经理，博信资

本业务合伙人。现任得仕股份有限公司董事及副总经理，联新国际医疗集团投资管理委员会首席顾问，国海富兰克林基金管理有限公司独立董事。

管理层董事徐荔蓉先生，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、国富潜力组合混合基金和国富研究精选混合基金基金经理，管理层董事。

2、监事会成员

监事会主席余天丽女士，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，国海富兰克林基金管理有限公司监事会主席。

监事谭志华先生，中共党员，工商管理硕士、注册会计师。历任交通银行股份有限公司南宁分行科员、科长，国海证券有限责任公司稽核部职员、稽核部副总经理、合规部总经理、计划财务部总经理、稽核监察部总经理、国海证券股份有限公司稽核监察部总经理、财务总监兼战略管理部总经理。现任国海证券股份有限公司财务总监兼战略管理部总经理，广西北部湾股权托管交易所股份有限公司董事，国海创新资本投资管理有限公司董事，国海富兰克林基金管理有限公司监事。

职工监事张志强先生，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 指数增强基金和国富中证 100 指数增强分级基金基金经理、职工监事。

职工监事赵晓东先生，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（现更名为国富弹性市值混合基金）和国富潜力组合股票基金（现更名为国富潜力组合混合基金）的基金经理助理，国富沪深 300 指数增强基金基金经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司权益投资总监、QDII 投资总监、国富中小盘股票基金、国富焦点驱动混合基金、国富弹性市值混合基金和国富恒瑞债券基金基金经理、职工监事。

3、经营管理层人员

总经理吴显玲女士，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、董事长、国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事长。现任国海富兰克林基金管理有限公司副董事长兼总经理，兼任国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事长、代为履行总经理职责，同时兼任国海富兰克林投资管理（上海）有限公司执行董事兼总经理。

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、国富潜力组合混合基金和国富研究精选混合基金基金经理，管理层董事。

副总经理胡昕彦女士，工商管理硕士。历任中国银行上海市分行会计科科员，汇丰数据处理（上海）有限公司共同基金部高级专员，2004 年加入国海富兰克林基金管理有限公司，先后担任基金事务部副总经理、行政管理部副总经理、行政管理部总经理、总经理助理。现任国海富兰克林基金管理有限公司副总经理。

4、督察长

督察长储丽莉女士，中共党员，律师（非执业），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，管理层董事。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，同时兼任国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事会秘书。

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、国富弹性市值混合基金及国富潜力组合混合基金的基金经理助理，国富沪深 300 指数增强基金基金经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司权益投资总监、QDII 投资总监、职工监事，国富中小盘股票基金、国富焦点驱动混合基金、国富弹性市值混合基金及国富恒瑞债券基金的基金经理。

历任基金经理

无，该基金自成立以来一直由赵晓东先生任基金经理，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：吴显玲女士（总经理）；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）；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）；赵晓东先生（权益投资总监、QDII 投资总监、基金经理、职工监事）；全勇先生（风险控制部副总经理）。

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）

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

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：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

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。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISA3402)认证,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”。2013 年至 2015 年连续获得中国债券市场“优秀托管机构奖”,2015 年被中国银行业协会授予“养老金业务最佳发展奖”。

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，2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理处、证券投资基金托管处、委托资产托管处、境外资产托管处、保险资产托管处、风险管理处、技术保障处、营运中心、市场营销处、内控监管处、账户管理处，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，其中具有高级职称的专家 30 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

截止到 2016 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 332 只。

（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：王蓉婕

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

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

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

办公地址：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

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：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：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

电话：0755-83077278

传真：0755-83195050

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

办公地址：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：常振明

电话：010-89937369

传真：010-85230049

联系人：廉赵锋

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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

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 号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

电话：010-63636153

传真：010-63639709

联系人：朱红

客户服务电话：95595

公司网址：www.cebbank.com

(9) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 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

(10) 兴业银行股份有限公司
注册地址：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

(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
电话：022-58314846
传真：022-58316569
联系人：王宏
客户服务电话：400-888-8811
公司网址：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
办公地址：杭州市建国中路 99 号
法定代表人：张晨
电话：0571-87923324
传真：0571-87923214
联系人：张强
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

办公地址：中国苏州市工业园区钟园路 728 号

法定代表人：王兰凤

电话：0512-69868373

传真：0512-69868370

联系人：项喻楠

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：何春梅

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

电话：010-85130588

传真：010-65182261

联系人：权唐

客户服务电话：95587

公司网址：www.csc108.com

(16) 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

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：朱雅崑

客户服务电话：400-8888-666/ 95521

公司网址：www.gtja.com

(17) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

办公地址：上海市广东路 689 号海通证券大厦

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

办公地址：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

电话：010-66568450

传真：010-66568990

联系人：邓颜

客户服务电话：400-888-8888

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

电话：021-38162212

联系人：黄英

客户服务电话：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

(20) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

联系人：黄莹

客户服务电话：95523、4008895523

公司网址：www.swhysc.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

办公地址：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：0755-83734343

联系人：林生迎

客户服务电话：95565

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

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：010-60838696

传真：010-60833739

联系人：顾凌

客户服务电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

(23) 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

办公地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

电话：0531-68889155

传真：0531-68889357

联系人：吴阳

客户服务电话：95538

公司网址：www.zts.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：杨树财

电话：0431-85096517

联系人：安岩岩

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

办公地址：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

电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

联系人：郭熠

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

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

办公地址：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：蔡一兵

电话：0731-84403319

传真：0731-84403439

联系人：郭静

客户服务电话：400-88-35316

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：北京市西城区新街口外大街28号C座505

法定代表人：林义相

电话：010-66045608

传真：010-66045152

联系人：李景平

客户服务电话：010-66045678

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

办公地址：江苏省南京市大钟亭8号

法定代表人：步国旬

电话：025-52310550

传真：025-52310586

联系人：陈秀丛

客户服务电话：400-828-5888

公司网址：www.njzq.com.cn

（29）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

办公地址：江苏省南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人：周易

电话：0755-82492193
传真：0755-82492962
联系人：庞晓芸
客户服务电话：95597
公司网址：www.htsc.com.cn

(30) 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
法定代表人：牛冠兴
电话：0755-82558305
传真：0755-82558355
联系人：陈剑虹
客户服务电话：400-8001-001
公司网址：www.essence.com.cn

(31) 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
办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号
法定代表人：薛峰
电话：021-22169999
传真：021-22169134
联系人：刘晨、李芳芳
客户服务电话：95525
公司网址：www.ebscn.com

(32) 江海证券有限公司
注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
办公地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
法定代表人：孙名扬
电话：0451-85863719
传真：0451-82287211
联系人：刘爽

客户服务电话：400-666-2288

公司网址：www.jhzq.com.cn

(33) 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：周杨

客户服务电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(34) 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

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：奚博宇

客户服务电话：95579 或 4008-888-999

客户服务网站：www.95579.com

(35) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：孙秋月

客户服务电话：95548

公司网址：www.citicssd.com

(36) 上海华信证券有限责任公司

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

办公地址：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：陈海平

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.shhxzq.com

(37) 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

办公地址：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

电话：0755-23953913

传真：0755-83217421

联系人：洪诚

公司网站：www.citicsf.com

客服电话：400-990-8826

(38) 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：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

联系人：潘世友

电话：021-54509988

传真：021-64385308

客户服务电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

(39) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址: 杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室
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
联系人: 徐昶绯
电话: 021-60897840
传真: 0571-26697013
客户服务电话: 4000-766-123
公司网址: www.fund123.cn

(40) 上海好买基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 9 楼
法定代表人: 杨文斌
联系人: 张茹
电话: 021-20613600
传真: 021-68596916
客户服务电话: 400-700-9665
公司网址: www.ehowbuy.com

(41) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

注册地址: 上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室
办公地址: 上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12F
法定代表人: 汪静波
联系人: 徐诚
电话: 021-38509639
传真: 021-38509777
客户服务电话: 400-821-5399
公司网址: www.noah-fund.com

(42) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼
办公地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

客户服务电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

(43) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

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

联系人：马林

电话：010-59601366-7024

传真：010-62020355

客户服务电话：4008188000

公司网址：www.myfund.com

(44) 众升财富(北京)基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08

法定代表人：李招弟

联系人：李艳

电话：010-59497361

传真：010-64788016

客户服务电话：400-059-8888

公司网址：www.zscffund.com

(45) 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：上海市浦东大道555号裕景国际B座16楼

法定代表人：张跃伟

联系人：单丙焜

电话：021-20691869

传真：021-20691861

传真：客户服务电话：400-820-2899

公司网址：www.erichfund.com

(46) 海银基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元

办公地址：上海市浦东新区东方路 1217 号 6 楼

法定代表人：刘惠

联系人：毛林

电话：021-80133597

传真：021-80133413

客户服务电话：400-808-1016

公司网址：www.fundhaiyin.com

(47) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：鲍东华

联系人：程晨

电话：15921301165

传真：021-50783597

客户服务电话：400-821-9031

公司网址：www.lufunds.com

(48) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号

法定代表人：林卓

联系人：孙先帅

电话：0411-88891212

传真：0411-88891212

客户服务电话：400-6411-999

公司网址：www.taichengcaifu.com

(49) 奕丰金融服务(深圳)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: 深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115、1116、1307室

法定代表人: TAN YIK KUAN

联系人: 叶健

电话: 0755-8946 0500

传真: 0755-21674453

客户服务电话: 400-684-6500、400-684-0500

公司网址: www.ifastps.com.cn

(50) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址: 北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室

法定代表人: 蒋煜

联系人: 姜世斌

电话: 010-58170708

传真: 010-5817 0800

客户服务电话: 400 818 8866

公司网址: fund.shengshiview.com

(51) 上海景谷资产管理有限公司

注册地址: 浦东新区泥城镇新城路2号24幢N3809室

法定代表人: 苏凯

联系人: 沙海靖

电话: 021-61621602

传真: 021-61621602-819

客户服务电话: 021-61621602

公司网址: www.g-fund.com.cn

(52) 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(上海泰和经
济发展区)

法定代表人: 王翔

联系人：俞申莉

电话：021-65370077-209

传真：021-55085991

客户服务电话：021-65370077

公司网址：www.jiyufund.com.cn

(53) 大泰金石投资管理有限公司

注册地址：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

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 层

法定代表人：袁顾明

电话：021-20324159

传真：021-20324199

联系人：朱真卿

客户服务电话：4009282266

公司网址：www.dtfunds.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 5511

联系人：胡昕彦

(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

注册地址：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

机构名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 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

经办注册会计师：单峰、傅琛慧

联系人：傅琛慧

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

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、合理的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 2016 年 10 月 19 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至 2016 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 197,885,643.82 12.32

其中：股票 197,885,643.82 12.32

2 基金投资 — —

3 固定收益投资 1,256,745,569.02 78.26

其中：债券 1,256,745,569.02 78.26

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 59,850,289.78 3.73

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 70,363,190.76 4.38

8 其他资产 20,937,117.30 1.30

9 合计 1,605,781,810.68 100.00

注：本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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 191,663,804.69 11.95

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 3,058,463.70 0.19

E 建筑业 45,750.11 0.00

F 批发和零售业 32,547.63 0.00

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	1,701,398.51	0.11
J 金融业	177,223.18	0.01
K 房地产业	1,206,456.00	0.08
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	197,885,643.82	12.34

2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

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	002308	威创股份	7,087,286	113,680,067.44	7.09
2	600521	华海药业	1,093,414	28,341,290.88	1.77
3	600883	博闻科技	1,725,480	28,056,304.80	1.75
4	002553	南方轴承	1,600,000	21,424,000.00	1.34
5	600886	国投电力	467,655	3,058,463.70	0.19
6	300508	维宏股份	10,383	1,469,194.50	0.09
7	000711	京蓝科技	40,800	1,206,456.00	0.08
8	603189	网达软件	3,898	105,713.76	0.01
9	600908	无锡银行	8,902	92,313.74	0.01
10	601128	N 常银	13,784	84,909.44	0.01

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	71,881,473.20	4.48
2	央行票据	--	
3	金融债券	429,252,000.00	26.77
其中：政策性金融债 429,252,000.00 26.77			
4	企业债券	129,221,383.82	8.06
5	企业短期融资券	341,825,000.00	21.32
6	中期票据	278,276,000.00	17.36
7	可转债	6,289,712.00	0.39
8	同业存单	--	
9	其他	--	
10	合计	1,256,745,569.02	78.38

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	150213	15 国开 13	1,500,000	154,920,000.00	9.66
2	150212	15 国开 12	1,200,000	121,632,000.00	7.59
3	150220	15 国开 20	1,000,000	101,920,000.00	6.36
4	019539	16 国债 11	590,000	59,059,000.00	3.68
5	122409	15 龙湖 02	500,000	51,620,000.00	3.22

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

根据基金合同，本基金不投资贵金属。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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

9.1 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。

9.2 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。

10. 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。

11. 投资组合报告附注

11.1 本基金本期投资的前十名证券中，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、处罚的证券如下：

广东威创视讯科技股份有限公司（以下简称“威创股份”）于2016年2月收到广东证监局对威创股份下达的《关于对广东威创视讯科技股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（[2016]5号）和《关于对江玉兰采取出具警示函措施的决定》（[2016]6号）（以下简称《决定》）。威创股份于2015年9月至2015年12月期间，将募集资金5,300万元用于质押获取银行贷款，该事项未履行决策程序和信息披露义务。上述行为违反了《证券法》第十五条、《上市公司监管指引第2号—上市公司募集资金管理和使用的监管要求》第五条的有关规定。

威创股份已自行整改，并于2016年1月11日公开披露了上述情况，威创股份将认真吸取教训，切实加强对证券法律法规的学习，严格执行募集资金使用的分级

决策程序，规范募集资金使用和管理，杜绝此类事件再次发生。

本基金对威创股份投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究，上述事件不改变威创股份的长期投资价值。同时由于本基金看好威创股份经营体制灵活，估值较为合理，因此买入。本基金管理人对该股的投资决策遵循公司的投资决策制度。

11.2 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。

11.3 其他各项资产构成

序号 名称 金额（元）

1	存出保证金	172,164.15
2	应收证券清算款	1,294,207.88
3	应收股利	-
4	应收利息	19,460,464.69
5	应收申购款	10,280.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,937,117.30

11.4 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。

11.5 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。

截至 2016 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12月31日 -2.50% 0.81% -7.13% 0.82% 4.63% -
0.01%

2014年1月1日 - 2014年12月31日 35.27% 1.03% 32.48% 0.73% 2.79%
0.30%

2015年1月1日 - 2015年12月31日 9.09% 0.61% 7.06% 1.49% 2.03% -
0.88%

2016年1月1日 - 2016年9月30日 3.81% 0.15% -6.91% 0.94% 10.72% -
0.79%

2013年5月7日 - 2016年9月30日 49.35% 0.74% 22.62% 1.06% 26.73% -
0.32%

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0.90%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

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、根据《国海富兰克林旗下基金产品风险评级方法》和 2016 年 8 月 31 日采集的数据，本基金风险等级由“中高风险”调整为“中风险”，相应表述同步调整。

2、“重要提示”一章中更新了本招募说明书（2016 年第 2 号）所载内容截止日及有关财务数据和净值表现截止日。

3、“基金管理人”一章相关内容更新如下：

（1）更新了董事长麦敬恩（Gregory E. McGowan）先生的信息；

（2）更新了董事何春梅女士的信息；

（3）更新了董事胡德忠先生的信息；

（4）删除了监事刘俊红女士的信息；

（5）增加了监事谭志华先生的信息；

（6）更新了基金经理赵晓东先生的信息；

（7）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：

1) 新增了上海陆金所资产管理有限公司、北京晟视天下投资管理有限公司、上海景谷资产管理有限公司、上海基煜基金销售有限公司、大泰金石投资管理有限公司等代销机构的信息；

2) 更新了中国农业银行股份有限公司、华泰证券股份有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、众升财富（北京）基金销售有限公司、奕丰金融服务（深圳）有限公司等代销机构的信息；

3) 更新了审计基金财产的会计师事务所信息。

6、在“基金的投资基金投资组合报告”一章中，更新了本基金最近一期投资组合的内容，内容更新到 2016 年 9 月 30 日。

7、在“基金的业绩”一章中，更新了基金合同生效以来至 2016 年 9 月 30 日的本基金投资业绩。

8、更新了“其他应披露事项”一章中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

2016 年 12 月 21 日

