

国海富兰克林基金管理有限公司关于富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金修订基金合同、托管协议等法律文件的公告

根据有关法律法规和基金合同的规定，经与基金托管人协商一致，国海富兰克林基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对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”）基金合同、托管协议等法律文件进行修订。现将有关修订内容说明如下：

1、根据中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、2017 年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求，对本基金基金合同、托管协议等法律文件进行修订，并更新基金管理人、托管人信息；本基金基金合同具体修订详见附件《富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同修改前后文对照表》，托管协议具体修订详见附件《富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议修改前后文对照表》。

2、本次基金合同修订的内容和程序符合有关法律法规和基金合同的规定。本次基金合同修订的内容系因相应的法律法规发生变动而应当进行的必要修改，且对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，根据基金合同的约

定，可由基金管理人和基金托管人协商后修改，无需召开基金份额持有人大会，并已报中国证监会上海监管局备案。本次修订后的基金合同、托管协议自本公告发布之日起生效并在本公司网站发布，但为不影响原有基金份额持有人的利益，基金合同中“本基金对持续持有期少于 7 日的投资人收取不少于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产。”的条款将于 2018 年 3 月 31 日起正式实施。本基金将于 2018 年 3 月 31 日起，对持续持有本基金份额少于 7 日的投资人收取 1.5% 的赎回费，并全额计入基金财产。

3、本次基金合同和托管协议修订的内容，将在本基金定期更新的招募说明书中作相应调整。投资人办理基金交易等相关业务前，应仔细阅读本基金的基金合同、招募说明书及其更新、风险提示及相关业务规则和操作指南等文件。

4、投资者可登录本基金管理人网站（www.ftsfund.com）或拨打本基金管理人的客户服务电话（400-700-4518、95105680、021-38789555）进行咨询、查询。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现。投资有风险，敬

请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

国海富兰克林基金管理有限公司

2018年3月29日

附件：

- 1、《富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同修改前后文对照表》；
- 2、《富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议修改前后文对照表》。

富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同修改前后文对照表

章节	原文条款	修改后条款	修订依据
	内容	内容	
第一部分 前言	（一）订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国合同法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他有关法律、法规。	（一）订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、 <u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u> （以下简称“ <u>《流动性风险管理规定》</u> ”）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）和其他有关法律、法规。	将《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）纳入基金合同制订依据
第二部分 释义	无。	<u>13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订</u> <u>56、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等</u>	根据《流动性风险管理规定》补充释义
第六部分 基金份额的	（五）申购和赎回的金额 无	（五）申购和赎回的金额 <u>4.当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大</u>	《流动性风险管理规定》第十九条第

<p>申购与赎回</p>		<p><u>不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。具体请参见相关公告。</u></p>	<p>二款</p>
	<p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途 5. 本基金的申购费用应在基金投资者申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。</p>	<p>(六) 申购和赎回的价格、费用及其用途 5、本基金的申购费用应在基金投资者申购基金份额时收取，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，<u>本基金对持续持有期少于 7 日的投资人收取不少于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产；对于持有期限大于或等于 7 日的基金份额所收取的赎回费</u>，不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。</p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十三条</p>
	<p>(八) 拒绝或暂停申购的情形 发生上述暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停申购公告。如果基金投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给基金投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p>(八) 拒绝或暂停申购的情形 <u>6、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50% 集中度的情形时；</u> <u>7、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性，基金管理人与基金托管人协商一致暂停基金估值时，基金管理人应当暂停接受基金申购申请；</u> 发生上述第 1、2、3、4、5、7、8 项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体和基金管理人网站上刊登暂停申购公告。<u>当发生上述第 6 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基</u></p>	<p>《流动性风险管理规定》第十九、二十四条</p>

		<p>金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果基金投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给基金投资者。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	
<p>(九) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 4、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况。</p>		<p>(九) 暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 4、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性，基金管理人应与基金托管人协商一致暂停基金估值时，基金管理人应该暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。</p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十四条</p>
<p>(十) 巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 无</p>		<p>(十) 巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (3) 当基金发生巨额赎回时，在单个基金份额持有人赎回申请超过前一开放日基金总份额 10%的情形下，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以对单个基金份额持有人超过基金总份额 10%以上的赎回申请实施延期办理，其余赎回申请可以根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能</p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十一条 (二)</p>

		<u>赎回部分作自动延期赎回处理。</u>	
第七部分 基金合同当事人及权利义务	<p>(一) 基金管理人 注册地址: <u>广西南宁市滨湖路 46 号</u> 办公地址: <u>上海浦东新区富城路 99 号震旦国际大楼 18 层</u></p> <p>(二) 基金托管人 1. 基金托管人简况 法定代表人: <u>项俊波</u></p>	<p>(一) 基金管理人 注册地址: <u>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</u> 办公地址: <u>上海浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 9 楼</u></p> <p>(二) 基金托管人 1. 基金托管人简况 法定代表人: <u>周慕冰</u> <u>批准设立机关和批准设立文号: 中国银监会银监复[2009]13 号</u></p>	更新基金管理人与基金托管人信息
第十二部分 基金的投资	<p>(三) 投资范围 本基金的投资组合比例为: 股票资产占基金资产的 <u>30%—80%</u>; 债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 <u>20—70%</u>。其中, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 <u>5%</u>; 权证市值占基金资产净值的比例不超过 <u>3%</u>。</p>	<p>(三) 投资范围 本基金的投资组合比例为: 股票资产占基金资产的 <u>30%—80%</u>; 债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 <u>20—70%</u>。其中, 现金 <u>(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)</u> 或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 <u>5%</u>; 权证市值占基金资产净值的比例不超过 <u>3%</u>。</p>	《流动性风险管理规定》第十八条
	<p>(九) 投资限制 本基金的投资组合将遵循以下限制: (5) 保持不低于基金资产净值<u>5%</u>的现金或者到期日在一年以内的政府债券; 基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下, 因证券市</p>	<p>(九) 投资限制 本基金的投资组合将遵循以下限制: (5) 保持不低于基金资产净值<u>5%</u>的现金或者到期日在一年以内的政府债券, <u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;</u> <u>(9) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的</u></p>	《流动性风险管理规定》第十五、十六、十七、十八条

	<p>场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述(1)-(3)项以及(5)-(9)项规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>	<p><u>15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；</u> <u>(10) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。</u> <u>(11) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</u> 基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，<u>除第(5)、(8)、(10)、(11)项外</u>，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>	
<p>第十四部分 基金资产的估值</p>	<p>(七) 暂停估值的情形 无</p>	<p>(七) 暂停估值的情形 <u>5、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十四条</p>
<p>第十八部分 基金的信息披露</p>	<p>(一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《基金合同》及其他有关规定。</p>	<p>(一) 本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、<u>《流动性风险管理规定》</u>、《基金合同》及其他有关规定。</p>	<p>将《流动性风险管理规定》纳入信息披露依据</p>

	<p>(五) 公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： 6. 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告 无</p>	<p>(五) 公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： 6. 基金定期报告，包括基金年度报告、基金半年度报告和基金季度报告 <u>本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和半年度报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</u> <u>基金运作期间，如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</u></p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十六条 第二十七条</p>
	<p>(五) 公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： 7. 临时报告 无</p>	<p>(五) 公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： 7. 临时报告 <u>(27) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</u></p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十六条</p>

富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金托管协议修改前后文对照表

章节	原文条款	修改后条款	修订依据
	内容	内容	
一、基金托管协议当事人	<p>(一) 基金管理人 注册地址：广西南宁市琅东滨湖路 46 号 经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。</p> <p>(二) 基金托管人 1. 基金托管人简况 法定代表人：项俊波 经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；</p>	<p>(一) 基金管理人 注册地址：<u>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</u> 经营范围：<u>基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。</u></p> <p>(二) 基金托管人 1. 基金托管人简况 法定代表人：<u>周慕冰</u> <u>批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号</u> 经营范围：<u>吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结 算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外</u></p>	更新基金管理人、托管人信息

	<p>外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务；保险兼业代理业务。（企业依法自主选择经营项目，开展经营活动；依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）</p>	<p><u>汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。</u></p>	
<p>二、基金托管协议的依据、目的和原则</p>	<p>（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）等有关法律、法规（以下简称“法律法规”）基金合同及其他有关规定制订。</p>	<p>（一）订立托管协议的依据 本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）等有关法律、法规（以下简称“法律法规”）、<u>《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》</u>（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、基金合同及其他有关规定制订。</p>	<p>将《流动性风险管理规定》纳入托管协议制定依据</p>
<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 30%—80%；债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 20—70%。其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证市值占基金资产净值的比例不超过 3%。</p>	<p>本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 30%—80%；债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 20—70%。其中，现金<u>（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）</u>或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证市值占基金资产净值的比例不超过 3%。</p>	<p>《流动性风险管理规定》第十八条</p>

<p>三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查</p>	<p>投资限制： 本基金的投资组合将遵循以下限制： 7、保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述(1)-(3)项以及(5)-(9)项规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>	<p>(九)投资限制 本基金的投资组合将遵循以下限制： 7、保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，<u>其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</u> <u>9、本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的、且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；</u> <u>10、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。</u> <u>11、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</u> 基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，<u>除第7、8、10、11项外，</u>因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。</p>	<p>《流动性风险管理规定》第十五、十六、十七、十八条</p>
------------------------------	--	--	---------------------------------

<p>八、基金资产净值计算和会计核算</p>	<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形</p>	<p>(四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形 <u>(5) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停基金估值；</u></p>	<p>《流动性风险管理规定》第二十四条</p>
------------------------	-----------------------------	---	-------------------------