富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金更新招募说明书(摘要)

(2018年第2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】

富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证监会2009年7月20日证监基金字【2009】652号文核准募集,本基金的基金合同于2009年9月3日生效。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金管理人保证本招募说明书摘要的内容真实、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。

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。

本基金主要投资于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、债券、货币市场工具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),在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下,如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能预见的特殊情形下,可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击,发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者根据所持有份额享受基金的收益,但同时也要承担相应的投资风险。基金投资中的风险包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,某一基金的特定风险等。本基金为股票型基金,属证券投资基金中的中高风险与中高收益品种。投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。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2018年3月3日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年6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、国海富兰克林基金管理有限公司副董事长兼总经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司董事长,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。

副董事长麦敬恩(Gregory E. McGowan)先生,文学学士,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 Worldwide Inc. 执行副总裁、董事和法律总顾问。曾任多个富兰克林邓普顿公司董事,包括但不限于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),国海富兰克林基金管理有限公司董事长,中国人寿富兰克林资产管理有限公司股东代表。现任富兰克林邓普顿投资集团高级战略顾问,Templeton International Inc.执行副总裁及法律总顾问,Franklin Templeton France S.A和Franklin Templeton Strategic Investments, Ltd.董事,Templeton Investment Counsel, LLC执行副总裁,Franklin Templeton Investment Services Gmbh咨询委员会委员,Brinker Destinations Trust独立董事,国海富兰克林基金管理有限公司股东代表、副董事长,国海富兰克林资产管理(上海)有限公司董事,中国人寿富兰克林资产管理有限公司董事,国寿富兰克林(深圳)股权投资基金管理有限公司董事,Global Capital Plc.独立董事。

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企业金融服务委员会主任及深圳分公司总经理,国海富兰克林基金管理有限公司董事,国海富兰克林资产管理(上海)有限公司董事。

董事陆晓隽先生,工商管理硕士。历任上海市徐汇区旅游局科员,上海PSD管理咨询公司顾问、项目经理,华信惠悦咨询公司顾问、高级顾问、咨询经理、咨询总监,韬睿惠悦咨询(上海)有限公司全球数据业务中国区副总经理暨首席顾问、资本市场中国区总经理、人力资本业务中国区总经理暨首席顾问、中国区金融业董事总经理,国海证券股份有限公司战略管理部总经理。现任国海证券股份有限公司人力资源总监兼首席战略官、研究所所长、战略管理部总经理,国海富兰克林基金管理有限公司董事。

董事梁葆玲(Linda Liang)女士,CPA,加利福尼亚执照,经济学文学学士。历任毕马威会计师事务所加利福尼亚旧金山办事处税务监督高级专员,安永会计师事务所加利福尼亚圣何塞和帕洛阿尔托办事处税务顾问高级经理。梁葆玲女士于2005年加入富兰克林邓普顿投资集团,历任富兰克林邓普顿投资总部美国公司税及全球税总监,富兰克林邓普顿投资本控股私人有限公司(新加坡)亚洲规划与策略总监。现任邓普顿资产管理有限公司首席行政官,国海富兰克林基金管理有限公司董事,国海富兰克林资产管理(上海)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。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。

独立董事施宇澄先生,工商管理硕士,为奥迈资本管理有限公司创办人兼管理合伙人。施先生曾经担任中国人寿资产管理公司独立董事及中国人寿富兰克林资产管理(香港)公司独立董事,现任中国人寿资产管理公司另类投资咨询委员会成员,笔克远东控股公司(香港联交所主板上市公司)独立董事,国海富兰克林基金管理有限公司独立董事,以及上海发展研究基金会理事及兼职研究员。

管理层董事林勇先生,工商管理硕士。历任江西省人民银行调查统计处调查分析员,江西省资金融通中心融资部交易员,招商银行总行计划资金部资金交易中心经理,嘉实基金管理有限公司投资管理部基金经理,国泰基金管理有限公司固定收益部总监助理、基金经理,平安银行股份有限公司资金交易部总经理、金融市场事业部副总裁兼资产管理中心、投资交易中心总经理,资产管理事业部副总裁,平安磐海资本有限公司董事长兼总经理,平安证券股份有限公司资产管理事业部总经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司总经理、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。

监事梁江波先生,研究生班学历,中共党员,经济师、会计师。历任广西信托投资公司计划财务部核算一科副科长,太平洋保险公司(寿险)南宁分公司财务部会计,国海证券有限责任公司计划财务部会计核算部经理,国海良时期货有限公司财务总监兼财务部经理,国海证券股份有限公司财务管理部副总经理(主持工作)。现任国海证券股份有限公司财务管理部总经理,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、国富弹性市值混合基金和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

总经理林勇先生,工商管理硕士。历任江西省人民银行调查统计处调查分析员,江西省资金融通中心融资部交易员,招商银行总行计划资金部资金交易中心经理,嘉实基金管理有限公司投资管理部基金经理,国泰基金管理有限公司固定收益部总监助理、基金经理,平安银行股份有限公司资金交易部总经理、金融市场事业部副总裁兼资产管理中心、投资交易中心总经理、资产管理事业部副总裁,平安磐海资本有限公司董事长兼总经理,平安证券股份有限公司资产管理事业部总经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司总经理、管理层董事。

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、管理层董事。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。

副总经理王雷先生,硕士研究生。历任华东计算技术研究所技术安全部职员,平安证券有限责任公司成都及上海地区营业部总经理、南京北门桥路证券营业部总经理、经纪业务事业部执行总经理,招商基金管理有限公司华东机构理财中心副总监、机构理财部负责人。现任国海富兰克林基金管理有限公司副总经理。

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、国海富兰克林资产管理(上海)有限公司董事会秘书。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、基金经理

现任基金经理:

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。截至本报告期末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、职工监事、国富沪深300指数增强基金及国富中证100指数增强分级基金的基金经理。

历任基金经理:

2009年9月3日至2014年2月21日由赵晓东先生担任本基金基金经理,其中2013年3月21日-2014年2月21日与现任基金经理张志强先生共同管理本基金。

2016年5月5日至2017年9月19日由鲍翔先生担任本基金基金经理,与现任基金经理张志强先生共同管理本基金。

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:林勇先生(公司总经理);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);刘怡敏女士(固定收益投资总监、基金经理);叶斐先生(风险控制部总经理助理)。

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
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:贺倩

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(ISAE3402)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"。2012年荣获第十届中国财经风云榜"最佳资产托管银行"称号;2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的"托管银行优秀奖"和中央国债登记结算有限责任公司授予的"优秀托管机构奖"称号;2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的"养老金业务最佳发展奖"称号;2018年荣获中国基金报授予的公募基金20年"最佳基金托管银行"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,内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部,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近240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2018年06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425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)中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:易会满
客户服务电话:95588
公司网址:www.icbc.com.cn

(3)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

(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
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

(5)中国邮政储蓄银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街3号
办公地址:北京市西城区金融大街3号
法定代表人:李国华
电话:010-68858117
传真:010-68858117
联系人:王硕
客户服务电话:95580
公司网址:www.psbc.com

(6)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

(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
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

(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
办公地址:北京市东城区建国门内大街22号
法定代表人:吴建
电话:010-85238982
传真:010-85238680
联系人:徐昊光
客户服务电话:95577
公司网址: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
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

(10)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

(11)宁波银行股份有限公司
注册地址:宁波市鄞州区宁南南路700号
办公地址:宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人:陆华裕
电话:0574-89068340
传真:0574-87050024
联系人:任巧超
客户服务电话:95574
公司网址:www.nbcb.com.cn

(12)东莞银行股份有限公司
注册地址:东莞市莞城区体育路21号
办公地址:东莞市莞城区体育路21号
法定代表人:廖玉林
电话:0769-22119061
传真:0769-22117730
联系人:吴照群
客户服务电话:4001196228
公司网址:www.dongguanbank.cn

(13)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

(14)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

(15)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

(16)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

(17)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

(18)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:朱雅崴
客户服务电话:400-8888-666/95521
公司网址:www.gtja.com

(19)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

(20)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

(21)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:上海市浦东新区长柳路36号
法定代表人:杨华辉
电话:021-38565547
联系人:乔琳雪
客户服务电话:95562
公司网址:www.xyzq.com.cn

(22)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

(23)申万宏源西部证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室(邮编:830002)
法定代表人:许建平
电话:010-88085858
传真:010-88085195
联系人:李巍
客户服务电话:400-800-0562
公司网址:www.hysec.com

(24)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

(25)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

(26)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:021-20315290
传真:0531-68889095
联系人:许曼华
客户服务电话:95538
公司网址:www.zts.com.cn

(27)广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
电话:020-87555888
联系人:黄岚
客户服务电话:95575
公司网址:www.gf.com.cn

(28)东北证券股份有限公司
注册地址:长春市生态大街6666号
办公地址:长春市生态大街6666号
法定代表人:李福春
电话:0431-85096517
联系人:安岩岩
客户服务电话:95360
公司网址:www.nesc.cn

(29)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
联系电话:0351-8686659
传真:0351-8686619
联系人:张慧斌
客户服务电话:400-666-1618、95573
公司网址:www.i618.com.cn

(30)财信证券有限责任公司
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

(31)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:李昱平
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

(32)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:王万君
客户服务电话:95386
公司网址:www.njzq.com.cn

(33)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

(34)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

(35)湘财证券股份有限公司
办公地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人:林俊波
电话:0731-84451488
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
公司网址:www.xcsc.com

(36)上海证券有限责任公司
注册地址:上海市黄浦区四川中路213号7楼
办公地址:上海市黄浦区四川中路213号7楼
法定代表人:李俊杰
电话:021-53686888
传真:021-53686100-7008,021-53686200-7008
联系人:邵珍珍
客户服务电话:021-962518
公司网址:www.962518.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
办公地址:安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人:蔡咏
电话:0551-62246273
传真:0551-62272108
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
公司网址:www.gyzq.com.cn

(38)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路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

(39)东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:赵俊
电话:021-20333333
传真:021-50498825
联系人:王一彦
客户服务电话:95531;400-888-8588
公司网址:www.longone.com.cn

(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
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

(41)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

(42)华宝证券有限责任公司
注册地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心57楼
办公地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心57楼
法定代表人:陈林
电话:021-68778790
传真:021-68778113
联系人:刘闻川
客户服务电话:400-820-9898
公司网址:www.cnhbstock.com

(43)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
办公地址:福州市五四路新天地大厦7、8层
法定代表人:黄金琳
电话:0591-83893286
传真:0591-87383610
联系人:徐松梅
客户服务电话:96326(福建省外加拨0591)
公司网址:www.hfzq.com.cn

(44)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

(45)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

(46)西南证券股份有限公司
注册地址:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:吴坚
电话:023-63786633
传真:023-63786212
联系人:张煜
客户服务电话:95355 、4008096096
公司网址: www.swsc.com.cn

(47)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:上海市黄浦区南京西路399号明天广场20楼
法定代表人:陈灿辉
电话:021-63898427
传真:021-68776977-8427
联系人:徐璐
客户服务电话:400-820-5999
公司网址:www.shhxzq.com

(48)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

(49)平安证券股份有限公司
注册地址:深圳福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号平安金融大厦26层
法定代表人:曹实凡
电话:021-38631117
传真:021-58991896
联系人:周驰
客户服务电话:95511-8
公司网址:stock.pingan.com

(50)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号26楼
法定代表人:其实
联系人:潘世友
电话:021-54509998
传真:021-64385308
客户服务电话:400-1818-188
公司网址:www.1234567.com.cn

(51)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:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法定代表人:陈柏青
联系人:韩爱彬
电话:0571-26888888
传真:0571-26697013
客户服务电话:4000-766-123
公司网址:www.fund123.cn

(52)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:王诗屿
电话:021-20613643
传真:021-68596916
客户服务电话:400-700-9665
公司网址: www.ehowbuy.com

(53)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:上海市杨浦区秦皇岛路32号C栋2楼
法定代表人:汪静波
联系人:余翼飞
电话:021-80358749
传真:021-38509777
客户服务电话:400-821-5399
公司网址:www.noah-fund.com

(54)深圳众禄基金销售股份有限公司
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8号HALO广场4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

(55)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:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦6楼
法定代表人:闫振杰
联系人:李晓芳
电话:010-59601366-7167
传真:0351-4110714
客户服务电话:400-818-8000
公司网址: www.myfund.com

(56)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦1002室
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22 号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:刘洋
电话:010-85650628
传真:021-65884788
客户服务电话:400-920-0022
公司网址:licaike.hexun.com

(57)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

(58)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:上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人:张跃伟
联系人:常艳琴
电话:021-20691832
传真:021-20691861
客户服务电话:400-820-2899
公司网址:www.erichfund.com

(59)海银基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号4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

(60)上海陆金所基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号4楼
法定代表人:王之光
联系人:宁博宇
电话:021-20665952
传真:021-22066653
客户服务电话:400-821-9031
公司网址:www.lufunds.com

(61)深圳新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址: 深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层
法定代表人:马勇
联系人: 文雯
电话:010-83363101
传真:010-83363072
客服电话: 4001661188
公司网址: www.jrj.com.cn

(62)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:杭州市文二西路1号903室
办公地址:杭州市余杭区同顺街18号同花顺大楼4楼
法定代表人:凌顺平
联系人:费超超
电话:0571-88911818-8654
传真:0571-86800423
客户服务电话:4008-773-772
公司网址:www.5ifund.com

(63)北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院
法定代表人: 江卉
联系人:韩锦星
电话:13810801527
传真:010-89188000
客户服务电话:95118
公司网址:fund.jd.com

(64)武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址: 湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层1号4号
办公地址:湖北省武汉市江汉区淮海路中央商务区泛海国际SOHO城2301室
法定代表人: 陶捷
联系人:徐博
电话:027-83863772
传真:027-83862682
客户服务电话:400-027-9899
公司网址:www.buyfunds.cn

(65)上海联泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8 座3层
法定代表人: 燕斌
联系人:兰敏
电话:021-52822063
传真:021-52975270
客户服务电话:400-166-6788
公司网址:www.66zichan.com

(66)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

(67)奕丰基金销售有限公司
注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A 栋 201 室(入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道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TEO WEE HOWE
联系人:叶健
电话:0755-89460500
传真:0755-21674453
客户服务电话: 400-684-0500
公司网址:www.ifastps.com.cn

(68)大泰金石基金销售有限公司
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: 021-20324155
传真:021-20324199
联系人:赵明
客户服务电话:4009282266
公司网址:www.dtfunds.com

(69)上海景谷基金销售有限公司
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:袁飞
联系人:袁振荣
电话:021-61621602-807
传真:021-61621602-819
客户服务电话:021-61621602
公司网址:www.g-fund.com.cn

(70)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:冯培勇
电话:010-58170950
传真:010-58170800
客户服务电话:400 818 8866
公司网址:fund.shengshiview.com

(71)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:张巍婧
电话:021-65370077-255
传真:021-55085991
客户服务电话:021-65370077
公司网址:www.jiyufund.com.cn

(72)一路财富(北京)信息科技股份有限公司
注册地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪秀
电话:010-88312877
传真:+86(10)88312099
联系人:徐越
客户服务电话:4000011566
公司网址: www.yilucaifu.com

(73)珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人:肖雯
联系人:邱湘湘
电话:020-89629099
传真:020-89629011
客户服务电话:020-89629066
公司网址:www.yingmi.cn

(74)北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层1108号
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层
法定代表人: 王伟刚
联系人:王骁骁
电话:18601178886
传真:010-62680827
客户服务电话:400-619-9059
公司网址:www.hcjijin.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
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
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、潘晓怡
联系人:潘晓怡
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800

四、基金名称

富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金

五、基金的类型

股票型开放式证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金采用指数增强投资策略。通过量化风险管理方法,控制基金投资组合与标的指数构成的偏差,同时结合主动投资方法,在严格控制跟踪偏离风险的基础上,力争获得超越业绩比较基准标的投资收益,追求基金资产的长期增值。在正常市场情况下,本基金对业绩比较基准的年跟踪误差不超过8%。

七、基金的投资范围

本基金投资范围限于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、债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他证券品种,基金管理人在履行适当的程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为85%-95%,投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于80%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-15%,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%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证占基金资产净值的比例不高于3%。其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本基金除投资于目标指数的成份股票,包括沪深300指数的成份股和备选成份股以外,还可适当投资一级市场申购的股票(包括新股与增发),以在不增加额外风险的前提下提高收益水平。

八、基金的投资策略

本基金为增强型指数基金,以沪深300指数作为标的指数。通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术,控制与目标指数的偏离风险,在指数化投资的基础上进行适度优化调整和一级市场股票投资,追求超越业绩比较基准的收益水平。

1、资产配置策略

本基金以追求基金资产长期增长的稳定收益为宗旨,在股票市场上进行指数化被动投资的基础上,基金管理人在债券(国债为主)、股票、现金等各类资产之间仅进行适度的主动配置。通过运用深入的基本面分析及先进的数量化技术,控制与目标指数的跟踪误差,追求适度超越目标指数的收益。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为85%-95%,投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于80%,现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-15%,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%,权证占基金资产净值的比例不高于3%。

在实际运作过程中,由于受市场价格波动、股票交易的零股限制、基金申购赎回情况等因素的影响,基金的资产配置比例可能会在规定比例上下小幅波动,基金经理小组及风险管理小组将对此进行实时的监控和调整。

2、股票投资策略

本基金以指数化投资为主,以最小化跟踪误差为组合的投资控制目标,本基金所跟踪的目标指数为沪深300指数。

本产品在指数化投资的基础上辅以有限度的增强操作(优化调整)及一级市场股票投资。具体而言,基金将基本依据目标指数的成份股构成权重,并借助数量化投资分析技术构造和调整指数化投资组合。在投资组合建立后,基金定期对比检验组合与比较基准的偏离程度,适时对投资组合进行调整,使指数优化组合与目标指数的跟踪误差控制在限定的范围内。在正常市场情况下,本基金对业绩比较基准的年跟踪误差不超过8%。此外,本基金将利用所持有股票市值参与一级市场股票投资,以在不增加额外风险的前提下提高收益水平,争取获得超过指数的回报。

◇控制跟踪误差

跟踪误差(TE)是指一段时间内,投资组合收益率与比较基准收益率的总体偏离程度的标准差。

本基金将"年化跟踪误差"作为投资风险控制的主要指标,年化跟踪误差允许的最大值为8%。跟踪误差的主要控制方法是:

1、组合构成偏差控制

组合跟踪误差的主要来源是资产配置和行业配置差异,因此本基金在投资管理过程中严格控制基金组合与业绩比较基准的资产配置和行业配置的偏差。当资产配置差异或行业配置差异超出允许的上限时,及时对组合进行再平衡,将上述偏差控制在允许的范围内。

2、跟踪误差量化控制

在本基金的投资管理过程中,每日通过回测分析计算基金组合以及股票组合的跟踪误差及其构成。当跟踪误差超过允许的最大值时,将根据误差贡献分析调整贡献度较大的偏离因素,如非股票类资产权重、非指数成分股权重和偏离较大的行业等,务必将目标组合的跟踪误差控制在允许的范围内。

◇分层抽样

本基金的股票投资部份的投资采用分层抽样法,分层抽样即按照沪深300指数的行业配置比例构建投资组合,本基金将沪深300指数成份股票按行业划分,以不同行业类别在指数中所占的权重来决定该行业在本基金实际投资组合中的投资权重,然后分别从每个行业中按照股票风险特征值(包括与行业相关性、beta值、股票市值、PE、PB等)选出最能代表该行业的样本股,投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。通过对最优化算法模型的应用(市值作为主要考察的因素),计算出追踪组合内各样本股的最优权重,力求组合表现与指数相一致,即跟踪误差最小,同时保证较小的调整频率和跟踪成本。本基金通过分层抽样法力争实现对沪深300指数的跟踪。

◇增强操作

本基金的增强操作即对投资组合进行优化,进行优化的根本依据是国内股票市场的非完全有效性和指数编制本身的局限性及时效性,指数化基础上的增强投资将通过仓位调整、调整权重和股票替代来实现。

① 仓位调整

在能够明确判断市场将经历一段长期下跌过程时,基金的股票投资仓位可进行下调,股票投资仓位最低可下调到占基金资产净值的85%以适度规避市场系统性风险。

② 组合优化

本基金在对沪深300指数各行业和个股进行深入研究的基础上,对投资组合优化调整,根据市值和行业板块的相对价值决定行业和个股相对于基准指标的配置比例。可能对一些预计收益超过平均水平的行业或个股增加投资的比例,而对一些预计收益低于平均水平的行业或个股调低投资比例。

◇流动性优化

本基金对投资组合品种的流动性评价指标包括:股票的流通市值和股票近半年的累积换手率、本基金要求投资组合品种的流动性达到投资决策委员会不定期设定的要求。本基金将提高具备要求流动性特征股票的投资权重

◇基本面优化

本基金主要基于对上市公司的基本面分析对指数化投资组合进行优化,提高具备要求基本面特征股票的投资权重,主要考虑以下因素:

公司基本面及竞争优势。

股票相对价值。

个股的市场机会和趋势。

股票的流动性。

③ 股票替代

◇一级市场股票投资

本基金通过适当投资一级市场申购的股票(包括新股与增发)以在不增加额外风险的前提下提高收益水平。

◇非成份股的投资。

在控制跟踪误差风险的前提下,对于经过深入研究具备投资价值的非指数成分股,本基金也可适度进行二级市场投资,控制投资比例,作为增强收益的方式之一。在保持行业配置不变的前提下,用投资价值突出的非成分股替代同行业的成分股,获取超额收益。

非成份股投资选择指标:

a) 预期未来两年盈利增长超过行业平均;

b) 近三年平均ROE大于行业平均;

c) 综合考虑盈利情况,结合估值PE、PB等指标,估值有一定安全边际。

对于停牌或由于规避关联交易等原因无法进行投资的指数成分股,本基金通过行业分析、市值规模分析、相关性分析,可以选择特征相似的非成分股进行替代。

3、债券投资策略

本基金将在对宏观经济和资本市场进行研究的基础上,对利率结构、市场利率走势进行分析和预测,综合考虑中债国债指数各成份券种及金融债的收益率水平、流动性的好坏等因素,进行优化选样构建本基金的债券投资组合。

本基金以富兰克林邓普顿集团固定收益类资产投资研究平台及本基金管理人的投资研究平台为依托,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基础上确定恰当的久期目标,合理控制利率风险。当预期利率整体上升时降低组合久期;当预期利率整体下降时提高债券组合久期。

3)期限结构配置

当确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率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性、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三者的最佳平衡点。

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。

债券投资的基本面分析重点是国家宏观经济状况、货币政策、利率变动前景及信用状况。技术分析主要是债券供求状况、收益变动、交易量等。本基金可投资的债券品种包括国债、金融债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、可转债及其他货币市场工具等。

国债品种信用风险小,重点分析国债品种的利率风险、流动性风险,并且关注投资者结构,根据利率预测模型构造最佳期限结构的国债组合。

在选择金融债、企业债、公司债品种时,重点分析债券的市场风险和信用风险,信用风险主要考察发行人及担保人的投资信品质、财务状况、历史违约情况、担保情况等。

本基金将可在严格控制组合投资风险的前提下投资于资产支持证券。主要从资产池信用状况、违约相关性、历史违约记录和损失比例、证券的信用增强方式、利差补偿程度等方面对资产支持证券各个分支的风险与收益状况进行评估,根据基金投资组合管理的目标选择合适的分支进行投资。

九、基金的投资决策流程

本基金通过对不同层次的决策主体明确投资决策权限,建立了完善的投资决策体系和投资运作流程:

(1)投资决策委员会会议:为基金管理人的最高投资决策机构,由投资决策委员会主席主持,对基金经理或其他投资决策委员会成员提交的基金投资策略、战略资产配置、投资范围和权限等重大投资决策事项进行深入分析、讨论并做出决议。

(2)在借助外部研究成果的基础上,研究分析部对标的指数成份股和备选成份股,以及其他投资标的进行独立研究,并依据研究成果建立基金股票池。

(3)基金经理根据投资决策委员会授权和会议决议,在研究分析部的研究支持下,拟定投资计划。

(4)基金经理根据投资决策委员会会议的决议进行投资组合构建或调整。在组合构建和调整的过程中,基金经理必须从基金股票池中选择投资标的,并严格遵守基金合同的投资限制及其他要求。

(5)中央交易室按照有关制度流程负责执行基金经理的投资指令,并担负一线风险监控职责。

(6)投资风险管理部门采用量化模型分析基金投资组合对业绩比较基准的偏离,并提供基金经理进行组合调整时参考。

(7)风险管理和业绩分析会议:由投资决策委员会主席主持,研究主管和风险管理经理参加。风险管理经理向会议提交最新的投资风险和业绩评估报告,会议讨论基金投资合规控制和风险管理事项并形成决议,同时依据绩效分析的结果提出组合调整建议。

(8)基金经理根据风险管理和业绩分析会议决议或建议,对投资组合进行调整,以确保遵守各项合规控制和风险管理要求。

十、基金的业绩比较基准

本基金以沪深300指数为标的指数。

本基金业绩比较基准为:95% × 沪深300指数 + 5% × 银行同业存款利率。

如果沪深300指数停止编制或发布,或沪深300指数供应商终止授权本基金使用其作为标的指数,或沪深300指数供应商发生重大事件威胁到其提供和授权沪深300指数的能力,或由于证券市场重大变化或沪深300指数编制方法重大变更导致其不适合继续作为本基金的标的指数,或法律法规及基金合同规定的其他可能情形,本基金管理人在履行适当程序后,可以变更基金的标的指数和业绩比较基准,并在变更前至少提前10个工作日在指定媒体上公告。

中证系列指数由中证指数有限公司编制和计算。关于指数值和成分股名单的所有版权归属中证指数有限公司。

十一、基金的风险收益特征

本基金是股票指数增强型基金,属于中高风险、中高预期收益的证券投资基金。本基金的净值波动与股票市场的整体波动高度相关。本基金将在控制与业绩比较基准偏离风险的基础上,力争获得超越业绩比较基准的收益。

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—中国农业银行根据本基金合同规定,于2018年7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至2018年6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	136,047,753.88	91.94
	其中:股票	136,047,753.88	91.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,680,497.09	7.89
8	其他资产	241,512.55	0.16
9	合计	147,969,763.52	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)报告期末按行业分类的境内股票投资组合

1)积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	667,206.00	0.45
B	采矿业	310,820.72	0.21
C	制造业	8,681,590.50	5.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	470,875.40	0.32
E	建筑业	2,223,666.50	1.51
F	批发和零售业	1,525,722.00	1.04
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	383,573.60	0.26
J	金融业	142,748.00	0.10
K	房地产业	1,133,679.20	0.77
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	81,226.14	0.06
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	15,621,108.06	10.62

2)指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,155,893.22	2.15
C	制造业	47,236,526.74	32.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,688,554.00	1.15
E	建筑业	4,455,012.30	3.03
F	批发和零售业	4,267,885.86	2.90
G	交通运输、仓储和邮政业	3,129,311.00	2.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,096,607.88	2.11
J	金融业	42,598,370.80	28.97
K	房地产业	6,311,561.62	4.29
L	租赁和商务服务业	3,729,530.40	2.54
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	757,392.00	0.52
S	综合	-	-
	合计	120,426,645.82	81.90

(2)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未通过港股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股票投资明细

(1)指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	177,962	10,425,013.96	7.09
2	600519	贵州茅台	8,031	5,874,355.26	4.00
3	601166	兴业银行	323,000	4,651,200.00	3.16
4	600016	民生银行	640,355	4,482,485.00	3.05
5	000651	格力电器	90,442	4,264,340.30	2.90
6	000540	中天金融	915,900	3,828,462.00	2.60
7	600516	方大炭素	149,400	3,642,372.00	2.48
8	000725	京东方A	879,200	3,112,368.00	2.12
9	002415	海康威视	72,600	2,695,638.00	1.83
10	601668	中国建筑	485,520	2,650,939.20	1.80

(2)积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002001	新和成	121,290	2,299,658.40	1.56
2	000040	东旭蓝天	220,165	2,223,666.50	1.51
3	600708	光明地产	227,104	976,547.20	0.66
4	300159	新研股份	128,800	911,904.00	0.62
5	600230	沧州大化	39,320	871,331.20	0.59

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同,本基金不投资股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

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:

兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")于2018年5月4日收到中国银行保险监督管理委员会(以下简称"中国银保监会")出具的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监银罚决字(2018)1号)》,就兴业银行主要违法违规事实公告如下:(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;(二)非真实转让信贷资产;(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务;(四)内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规;(五)同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保;(六)债券卖出回购业务违规出表;(七)个人理财资金违规投资;(八)提供日期倒签的材料;(九)部分非现场监管统计数据与事实不符;(十)个别董事未经任职资格核准即履职;(十一)变相批量转让个人贷款;(十二)向四证不全的房地产项目提供融资。

中国银保监会处以罚款人民币5,870万元。

本基金对兴业银行投资决策说明:本公司的投研团队经过充分研究,认为上述事件仅对兴业银行短期经营有一定影响,不改变长期投资价值。同时由于本基金看好银行整体的长期发展前景,因此买入兴业银行。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。

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)其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	138,305.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,769.66
5	应收申购款	100,436.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	241,512.55

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间的可转债。

5)期末指数投资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	000540	中天金融	3,828,462.00	2.60	重大资产重组停牌

6)期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告本期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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。

截至2018年6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
2009年9月3日-2009年12月31日	15.50%	1.44%	22.47%	1.75%	-6.97%	-0.31%
2010年1月1日-2010年12月31日	-5.89%	1.46%	-11.77%	1.50%	5.88%	-0.04%
2011年1月1日-2011年12月31日	-22.72%	1.23%	-23.82%	1.23%	1.10%	0.00%
2012年1月1日-2012年12月31日	12.62%	1.22%	7.30%	1.22%	5.32%	0.00%
2013年1月1日-2013年12月31日	-7.72%	1.31%	-7.14%	1.32%	-0.58%	-0.01%
2014年1月1日-2014年12月31日	47.42%	1.12%	48.72%	1.15%	-1.30%	-0.03%
2015年1月1日-2015年12月31日	8.31%	2.40%	5.72%	2.36%	2.59%	0.04%
2016年1月1日-2016年12月31日	-7.25%	1.44%	-10.61%	1.33%	3.36%	0.11%
2017年1月1日-2017年12月31日	14.61%	0.61%	20.65%	0.60%	-6.04%	0.01%
2018年1月1日-2018年6月30日	-12.05%	1.07%	-12.24%	1.10%	0.19%	-0.03%
2009年9月3日-2018年6月30日	30.33%	1.41%	22.05%	1.41%	8.28%	0.00%

十四、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、基金合同生效后的信息披露费用;

4、基金份额持有人大会费用;

5、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;

6、基金的证券交易费用;

7、基金财产拨划支付的银行费用;

8、基金的指数许可使用费;基金的指数许可使用费从基金财产中列支。

根据《中证指数公司指数使用许可协议》,在通常情况下,指数许可使用费按前一日的基金资产净值的0.016%的年费率计提。每日计算,逐日累计。

计算方法如下:

H=E×0.016%÷当年天数

H为每日应付的指数许可使用费,E为前一日的基金资产净值。

自基金合同生效日起,指数许可使用费每季度支付一次,指数许可使用费的收取下限为每季度人民币5万元整(即不足5万元时按照5万元收取)。当年基金合同生效不足一个季度的,按照一个季度收费。

在基金存续期内,如果《中证指数公司指数使用许可协议》中关于"指数许可使用费"内容有所修改的,将按照最新的内容进行费用计提和支付。

9、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)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价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(三)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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.85%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.85%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为0.85%

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金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

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.15%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.15%

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3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、上述(一)中3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。

(四)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,由基金管理人承担。

(五)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,并报中国证监会批准。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施前2日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

(六)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、"重要提示"一章中将基金的风险收益特征调整为中高风险,,更新了本招募说明书(2018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。

2、在"基金管理人"一章中相关内容更新如下:

(1)新增了董事陆晓隽先生的信息。

3、"基金托管人"一章更新了基金托管人部分信息。

4、"相关服务机构"一章更新如下:

新增了北京汇成基金销售有限公司等代销机构的信息。

更新了东北证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、北京展恒基金销售股份有限公司、和讯信息科技有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、北京肯特瑞财富投资管理有限公司、奕丰基金销售有限公司等代销机构信息。

5、"基金的投资"一章中将基金的风险收益特征调整为中高风险,更新了基金投资组合报告中本基金最近一期投资组合的内容,内容更新至2018年6月30日。

6、"基金的业绩"一章更新了基金合同生效以来至2018年6月30日的本基金投资业绩。

7、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
2018年10月13日