# 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）

（2011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。

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。

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较高风险与较高收益品种。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2011年9月3日，有关财务数据和净值表现截止日为2011年06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：广西南宁市琅东滨湖路46号
办公地址：上海浦东新区富城路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：国海证券股份有限公司持有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，国海证券股份有限公司副总经理，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。现任索芙特股份有限公司董事长兼总经理。

董事齐国旗先生，经济学硕士。历任河南大学党委组织部干部科科长，君安证券有限责任公司总裁办公室职员、债券业务部总经理助理、副总经理，国泰君安证券股份有限公司债券业务一部、资本运作总部副总经理、收购兼并总部上海业务部负责人，民生证券有限责任公司副总裁，国海证券股份有限公司副总裁、总裁。现任国海证券股份有限公司总裁。

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

董事张伟先生，硕士研究生学历。历任澳组银行集团（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、德意志银行（香港）有限公司副总裁、德意志信托（香港）有限公司董事、德意志信托有限公司（英国）联席董事。现任富兰克林邓普顿投资集团大中华区总监及董事。

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

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

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）双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。现任兴证投资集团（中国）董事长、亚洲环球证券公司（香港）董事长、菲律宾信安银行独立董事。

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

2.监事会成员

监事会主席何雅玲女士，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，国海证券股份有限公司稽核监察部总经理。现任国海证券股份有限公司总裁助理。

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、业务发展部总经理。

3.经营管理层人员

拟任总经理李雄厚先生，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、国海富兰克林基金管理有限公司副总经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司拟任总经理。

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：

赵晓东先生：7年证券从业经验，香港大学MBA，辽宁工程技术大学经济学学士。曾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，国海富兰克林基金管理有限公司高级研究员，弹性市值基金经理助理和潜力组合基金经理助理。从事煤炭、机械、汽车、交通运输和IT等行业的研究工作。现任富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金与富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金的基金经理。

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：李雄厚先生（公司拟任总经理，兼任投资决策委员会代理主席）；张晓东先生（基金经理）；宋国庆先生（基金经理兼权益类投资团队负责人）；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：项俊波
成立日期：2009年1月15日
注册资本：32,479,411.7万元人民币
存续期间：持续经营
联系电话：010-63201510
传真：010-63201816
联系人：李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务期限范围最广、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“特你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

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

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

2.主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工130名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3.基金托管业务经营情况

截止2011年9月1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106只，包括富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、双盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成优选证券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全优指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长灵活配置股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、长城复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、大岩稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票型证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金（LOF）、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、南方中证500指数证券投资基金（LOF）、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴业沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票型证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元比联保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金。

（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：广西南宁市琅东滨湖路46号
办公地址：上海浦东新区富城路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
传真：021-6887 0708

2.代销机构：

（1）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
联系人：滕玮
客户服务电话：95599
公司网站：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
法定代表人：姜建清
电话：010-66105662
传真：010-66107914
联系人：查樱
客户服务电话：95588
公司网站：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
法定代表人：肖钢
客户服务电话：95566
公司网站：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：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）中国邮政储蓄银行有限责任公司
注册地址：北京市西城区宣武门西大街131号
办公地址：北京市西城区金融大街3号
法定代表人：刘安东
联系人：陈春林
传真：010- 68858116
客户服务电话：95580
网址：www.psbc.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：董云巍
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、虞合云
客户服务电话：95528
公司网站：www.spdb.com.cn

（11）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

（12）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：胡昙
客户服务电话：0769-96228
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
联系人：王宏
传真：022-58316569
客户服务电话：400-888-8811
网址：www.cbhb.com.cn

（14）国海证券股份有限公司
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

（15）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

（16）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人：万建华
客户服务电话：400-8888-666
公司网址：www.gtja.com

（17）海通证券股份有限公司
注册地址：
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
电话：021-23219000
传真：021-23219100
联系人：李笑鸣
客户服务电话：95553或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网址：www.htsec.com

（18）中国银河证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人：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

（19）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

（20）申银万国证券股份有限公司
注册地址：上海市常熟路171号
法定代表人：丁国荣
电话：021-54033888
客户服务电话：021-962505
联系人：邓骤冰
网址：www.sw2000.com.cn

（21）招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人：宫少林
电话：0755-82943666
传真：0755-82943636
联系人：林生韶
客户服务电话：95565、400-8888-111
公司网站：www.newone.com.cn

（22）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

（23）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

（24）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.qilzq.com.cn

（25）万家证券股份有限公司
注册地址：广州市天河北路183号大都会广场43楼（4301-4316房）
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：林治海
电话：020-87555888
客户服务电话：95575
开放式基金业务传真：020-87555305
联系人：黄岚
网址：www.gf.com.cn

（26）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：潘鹏
电话：0431-85096709
客户服务电话：400-600-0686
网址：www.nesc.cn

（27）山西证券股份有限公司
注册地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：侯巍
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

（28）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

（29）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
联系电话：010-66045446
公司网站：www.hxsec.com、www.txjijin.com

（30）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

（31）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：俞会荣
电话：0571-85776115
传真：0571-85783771
客户服务电话：0571-96598
网址：www.96598.com.cn、www.bigsun.com.cn

（32）华泰证券股份有限公司
地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
电话：025-83290979
传真：025-51863323
联系人：程高峰、万鸣
客户服务电话：95597
公司网站：www.htsc.com.cn

（33）湘财证券有限责任公司
办公地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
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

（34）投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

（35）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

（36）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：张璇
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

（37）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
通讯地址：上海市静安区新闸路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

（38）红塔证券有限公司
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

（39）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

（40）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

（41）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

（42）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

（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
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.hfzq.com.cn

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
电话：021-3855 5601
联系人：董卫军

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所
住所：上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室
办公地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人：廖海
联系电话：（021）51150298
传真：（021）51150398
联系人：廖海
经办律师：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%。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。

a.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。

b.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（市值作为主要考虑的因素），计算出追踪组合内各样本股的股优权重，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。

c.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，作为增强收益的方式之一。在保持行业配置不变的前提