

富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金  
更新招募说明书(摘要)  
(2017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：中国银行股份有限公司

## 重要提示

本基金的募集申请于2013年12月30日经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1648号文注册,本基金的基金合同于2014年9月23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监会注册,但中国证监会对本基金募集申请的注册,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。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型,投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期,也将承担不同程度的风险。一般来说,基金的收益预期越高,投资者承担的风险也越大。本基金为股票型基金,属于证券投资基金中的较高风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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。

投资有风险,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2017年9月23日，有关财务数据和净值表现截止日为2017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：上海浦东新区世纪大道 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。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，中国人寿富兰克林资产管理有限公司股东代表，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。

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上市代表、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国海证券股份有限公司常务副总裁。现任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。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。

期后事项说明:

经公司股东会 2017 年第五次会议决议审议通过,自 2017 年 9 月 26 日起,胡德忠先生不再担任公司第五届董事会董事,由陆晓隽先生接替胡德忠先生担任公司第五届董事会董事。

## 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总经理,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：

王晓宁先生，中央财经大学学士学位。历任万家基金管理有限公司研究员、研究总监助理、基金经理助理，国海富兰克林基金管理有限公司行业研究主管，国富潜力组合股票基金、国富成长动力股票基金和国富策略回报混合基金的基金经理助理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司研究分析部副总经理，国富策略回报混合基金及国富健康优质生活股票基金的基金经理。

历任基金经理：

无，该基金自成立以来尚未发生基金经理离任。

#### 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

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人：田国立

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

### (二) 基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

### (三) 证券投资基金托管情况

截至2017年06月30日，中国银行已托管611只证券投资基金，其中境内基金574只，QDII基金37只，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**

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### **(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》、《公开募集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，及时通知基金管理人，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，应当及时通知基金管理人，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：上海浦东新区世纪大道 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 5651

传真：021-6887 0708

2、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

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

公司网站：www.boc.cn

(2) 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

(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](http://www.bankcomm.com)

(5) 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](http://www.cbhb.com.cn)

(6) 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](http://www.suzhoubank.com)

(7) 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

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

(8) 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](http://www.nesc.cn)

(9) 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](http://www.cfzq.com)

(10) 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

( 11 ) 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

( 12 ) 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

( 13 ) 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

(14) 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

(15) 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



(16) 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：吴嘉虹

客户服务电话：95562

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

(17) 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](http://www.newone.com.cn)

(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](http://www.chinastock.com.cn)

(19) 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

( 20 ) 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

( 21 ) 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

( 22 ) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 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

( 23 ) 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

( 24 ) 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

( 25 ) 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

( 26 ) 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

( 27 ) 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

( 28 ) 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

( 29 ) 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

( 30 ) 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](http://www.citicsf.com)

客服电话：400-990-8826

( 31 ) 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：石静武

客户服务电话：95511-8

公司网址：stock.pingan.com

( 32 ) 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：021-54509988

传真：021-64385308

客户服务电话：400-1818-188

公司网址：www.1234567.com.cn

( 33 ) 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

(34) 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：王诗琦

电话：021-20613643

传真：021-68596916

客户服务电话：400-700-9665

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

(35) 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：朱了

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](http://www.noah-fund.com)

(36) 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](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

( 37 ) 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邮电新闻大厦 15-1 号 2 楼

法定代表人：闫振杰

联系人：李波桥

电话：010-59601366-7024

传真：010-62020355

客户服务电话：4008188000

公司网址：www.myfund.com

( 38 ) 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：021-20835879

客户服务电话：400-920-0022

和讯理财客网址：licaike.hexun.com

( 39 ) 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：400-876-9988

公司网址：www.zscffund.com



(40) 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](http://www.fundhaiyin.com)

(41) 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

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：胡学勤

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-50783597

客户服务电话：400-821-9031

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

(42) 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](http://www.jrj.com.cn)

( 43 ) 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路3号

办公地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中路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](http://www.taichengcaifu.com)

( 44 ) 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道航天科技广场A座17楼1704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: 400-684-0500

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

( 45 ) 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: 021-20324159

传真: 021-20324199

联系人: 赵明

客户服务电话：4009282266

公司网址：www.dtfunds.com

(44) 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

(45) 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

(46) 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](http://www.jiyufund.com.cn)

(47) 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](http://www.yilucaifu.com)

(二) 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

法定代表人: 吴显玲

电话: 021-3855 5511

传真: 021-6888 0981

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

联系人: 刘佳

经办律师: 廖海、刘佳

联系电话: 021-51150298

传真: 021-51150398

(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**

富兰克林国海健康优质生活股票型证券投资基金

**五、基金的类型**

开放式股票型证券投资基金

**六、基金的投资目标**

本基金主要通过投资于有利于提升民众健康水平和能够满足人们优质生活需求的上市公司，在严格控制投资风险的基础上，力争获取基金资产的长期稳定增值。

**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：股票投资比例为基金资产的 80%—95%，其中投资于与提升居民健康和生活品质主题直接相关行业的股票比例不低于非现金基

金资产的 80%，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投资比例为基金资产的 5%-20%，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

本基金将重点关注有利于提升民众健康水平和能够提供优质生活产品和服务的行业和个股。

### 1、行业配置策略

(1) 本基金的股票资产采用“核心-卫星”策略进行行业配置。本基金的核心行业配置资产将主要投资于与提升居民健康和生活品质主题直接相关的行业，投资比例不低于非现金基金资产的 80%。按照申银万国一级行业划分，本基金的核心行业包括建筑材料、建筑装饰、电气设备、机械设备、国防军工、汽车、家用电器、休闲服务、计算机、传媒、通信、医药生物、房地产、银行、非银金融、纺织服装、交通运输、农林牧渔、食品饮料、商业贸易、轻工制造、公用事业、电子和化工，这些行业内的上市公司将作为本基金的主要投资方向。同时本基金的股票资产也配置于与提升居民健康和生活品质主题间接相关的行业，这部分称为卫星行业配置，投资比例不高于非现金基金资产的 20%。本基金的卫星行业包括采掘、钢铁、有色金属和综合等行业。

随着经济增长方式的转变和产业结构的升级，居民的需求也会发生变化，从而导致满足居民健康和优质生活需求的行业范围发生变化。本基金将通过对居民需求变化和行业发展趋势的研究，适时调整健康优质生活主题所覆盖的行业范围。此外，本基金将对申银万国行业分类标准进行密切跟踪，若日后该标准有所调整或出现更为科学的行业分类标准，本基金将在审慎研究的基础上，采用新的行业分类标准并重新界定健康优质生活主题所覆盖的行业范围。

(2) 本基金在具体进行行业配置时，根据宏观经济周期、国家产业政策、行业景气度和行业竞争格局等因素进行深入分析，结合行业盈利趋势预测、行业整体估值水平和市场特征等，进行综合的行业投资价值评估。

具体而言，本基金在评估行业投资价值时，主要考虑以下五个方面：

- 宏观经济状况，例如：经济增长情况、通胀水平、经济政策调整等；
- 行业运行情况，例如：行业景气度、国家产业政策、行业竞争格局等；
- 行业基本面信息，例如：行业成长性、行业盈利能力、行业内公司的财务健康性等；
- 行业的估值水平，即通过相对估值和绝对估值方法评估行业的整体估值水平，并通过各行业的横向比较，以及每个行业的历史数据比较，评估行业的整体估值优势；
- 市场特征，即分析市场资金流向、公开催化剂信息的影响等。

## 2、个股精选策略

本基金将采用“自下而上”精选个股策略，紧密围绕健康优质生活的投资主题，从主题、行业地位、公司发展战略、核心竞争力、公司治理结构和管理层分析、估值水平等方面进行综合评价，精选优质股票构建投资组合。

### (1) 主题评估

主题评估主要是从上市公司的产品和服务是否能对居民健康和生活品质产生积极影响、能够满足居民健康优质生活需求产品或服务比例及其对该公司收入和利润的贡献度以及上市公司对于上述业务的投入及发展规划等角度进行观察和研究。对公司主题的评估决定了其经营内容是否符合居民健康和生活品质的要求，是基金投资的首先要考虑的因素。

### (2) 行业地位评估

公司所在行业发展趋势良好，具有良好的行业成长性；公司在所属行业处于领先地位，并在短期内难以被行业内其他竞争对手超越；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。

### (3) 公司发展战略

公司具有清晰明确的发展战略，其发展战略应当体现出公司在改善居民健康和生活品质方面的意愿，并符合居民需求的变化趋势、产业发展方向和国家产业政策。

### (4) 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。

#### (5) 公司治理结构和管理层评价

良好的公司治理是公司健康发展的基础。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、保持并不断创造竞争优势的关键因素。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。

#### (6) 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。

### 3、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、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。

#### 5、权证投资策略

本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型确定其合理估值水平，谨慎地进行投资，在控制下跌风险、实现保值的前提下，追求较为稳定的增值收益。

### 九、基金的业绩比较基准

$85\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 15\% \times \text{中债国债总指数收益率（全价）}$

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

本基金是股票型基金，属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种，其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

## 十一、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授权范围，建立了完善的投资决策运作体系。

(1) 投资决策委员会会议：投资决策委员会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，讨论与投资相关的事务，并对重大投资决策做出决议。

(2) 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，根据市场情况，进行投资组合的构建或调整。在组合构建和调整的过程中，基金经理必须严格遵守有关法律法规、基金合同的投资限制及其他要求。

(3) 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。

(4) 风险控制部按照有关法律法规、基金合同和公司制度流程，对基金的投资行为和投资组合进行持续监控，并定期进行风险分析和报告，确保基金投资承担的风险在适当的范围内。

## 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2017年7月18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至2017年6月30日，本报告财务资料未经审计事务所审计。

## 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	15,642,462.06	89.31
	其中：股票	15,642,462.06	89.31
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	1,840,945.53	10.51
8	其他资产	30,617.86	0.17
9	合计	17,514,025.45	100.00

注：本基金未通过港股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

### 2.1 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	431,500.00	2.50
B	采矿业	894,280.00	5.19
C	制造业	10,585,332.06	61.42
D	电力、热力、燃气及水	336,300.00	1.95

	生产和供应业		
E	建筑业	357,500.00	2.07
F	批发和零售业	369,200.00	2.14
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	918,000.00	5.33
J	金融业	1,750,350.00	10.16
K	房地产业	-	-
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	15,642,462.06	90.77

## 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	600036	招商银行	45,000	1,075,950.00	6.24
2	002308	威创股份	80,000	1,044,000.00	6.06
3	600104	上汽集团	30,000	931,500.00	5.41
4	002450	康得新	40,000	900,800.00	5.23
5	000858	五粮液	15,041	837,182.06	4.86
6	002311	海大集团	40,000	730,800.00	4.24
7	002564	天沃科技	80,000	730,400.00	4.24
8	002460	赣锋锂业	15,000	693,750.00	4.03
9	002217	合力泰	70,000	691,600.00	4.01
10	601166	兴业银行	40,000	674,400.00	3.91

**4. 报告期末按券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  
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**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**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：

2017年5月25日，苏州天沃科技股份有限公司（以下简称“天沃科技”）收到深圳证券交易所（以下简称“深交所”）监管函：天沃科技2016年度计提各项资产减值准备合计9178.37万元，占2015年度归属于母公司所有者净利润的596.24%，天沃科技未在2017年2月底前将该事项提交董事会审议并履行相关信息披露义务。直至2017年5月19日，天沃科技召开董事会审议通

过《关于计提资产减值损失的议案》并披露《关于计提资产减值损失的公告》。上述行为违反了深交所《股票上市规则（2014年修订）》第2.1条、第2.7条、第11.11.3条和《中小企业板上市公司规范运作指引（2015年修订）》第7.6.3条的规定。深交所要求天沃科技董事会充分重视上述问题，吸取教训，杜绝上述问题的再次发生。

本基金对天沃科技的投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究，认为上述事件不改变天沃科技长期投资价值。同时由于本基金看好天沃科技在电力和化工EPC领域的发展前景，天沃科技控股的中机电力在电力EPC领域的市场地位高，未来将显著受益于行业集中度的提升和海外业务的拓展，此外，其化工EPC业务也面临底部拐点，因此买入天沃科技。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) 基金其他资产的构成：

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,507.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	425.95
5	应收申购款	23,684.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,617.86

4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期内未持有处于转股期间的可转债。

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2017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
2014年9月23日— 2014年12月31日	14.10%	1.03%	40.71%	1.34%	-26.61%	-0.31%
2015年1月1日— 2015年12月31日	9.20%	3.03%	6.45%	2.11%	2.75%	0.92%
2016年1月1日— 2016年12月31日	-14.21%	1.91%	-9.56%	1.19%	-4.65%	0.72%
2017年1月1日— 2017年6月30日	6.83%	0.72%	8.58%	0.49%	-1.75%	0.23%
2014年9月23日— 2017年6月30日	14.20%	2.20%	47.09%	1.54%	-32.89%	0.66%

### 十四、基金费用概述

#### (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、仲裁费和诉讼费；
- 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、证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- 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)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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起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、公休假等，支付日期顺延。

#### 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，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起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、公休日等，支付日期顺延。



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。

(四)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。

(五) 费用的调整

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。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

(六) 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。

## 十五、对招募说明书更新部分的说明

1、“重要提示”一章中更新了本招募说明书（2017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、“基金管理人”一章相关内容更新如下：

(1) 新增了董事长吴显玲女士的信息；

(2) 新增了副董事长麦敬恩（Gregory E. McGowan）先生的信息；

(3) 删去了副董事长吴显玲女士的信息；

(4) 删去了董事长麦敬恩（Gregory E. McGowan）先生的信息；

(5) 新增了董事梁葆玲（Linda Liang）女士的信息；

(6) 删去了董事阮博文先生的信息；

(7) 更新了董事胡德忠先生的信息；

(9) 新增了管理层董事林勇先生的信息；

- (10) 删去了管理层董事徐荔蓉先生的信息;
- (11) 新增了监事梁江波先生的信息;
- (12) 删去了监事谭志华先生的信息;
- (13) 新增了总经理林勇先生的信息;
- (14) 删去了总经理吴显玲女士的信息;
- (15) 更新了副总经理徐荔蓉先生的信息;
- (16) 更新了投资决策委员会成员的信息。

**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：**

(1) 基金份额发售机构：

新增了平安证券股份有限公司、一路财富（北京）信息科技股份有限公司代销机构的信息。

更新了以下代销机构的信息：兴业证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、上海好买基金销售有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、北京展恒基金销售股份有限公司、和讯信息科技有限公司、众升财富（北京）基金销售有限公司、海银基金销售有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、深圳新兰德证券投资咨询有限公司、奕丰金融服务（深圳）有限公司、大泰金石基金销售有限公司、北京晟视天下投资管理有限公司、上海基煜基金销售有限公司。

更新了会计师事务所相关信息。

**5、在“基金的投资”一章中，更新了截至 2017 年 6 月 30 日的“基金投资组合报告”的内容。**

**6、在“基金的业绩”一章中，更新了基金合同生效以来至 2017 年 6 月 30 日的本基金投资业绩。**

**7、更新了“其他应披露的事项”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

2017 年 11 月 3 日