

**富兰克林国海弹性市值股票型  
证券投资基金更新招募说明书  
(2008 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

本招募说明书条款未来如有修改，将在指定媒体公告，恕不另行书面通知

## 【重要提示】

富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2006 年 3 月 30 日证监基金字【2006】57 号文核准募集，本基金的基金合同于 2006 年 6 月 14 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作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，投资者认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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 2008 年 6 月 14 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2008 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

一、绪言 .....	4
二、释义 .....	5
三、基金管理人.....	9
四、基金托管人.....	20
五、相关服务机构.....	24
六、基金的募集.....	34
七、基金合同的生效.....	35
八、基金份额的申购与赎回.....	36
九、基金的投资.....	45
十、基金的业绩.....	55
十一、基金的财产.....	56
十二、基金资产的估值.....	58
十三、基金收益与分配.....	65
十四、基金费用与税收.....	67
十五、基金的会计与审计.....	69
十六、基金的信息披露.....	70
十七、风险揭示.....	75
十八、基金合同的变更、终止和基金财产的清算.....	78
十九、基金合同的内容摘要.....	81
二十、基金托管协议的内容摘要.....	95
二十一、对基金份额持有人的服务.....	105
二十二、其它应披露事项.....	108
二十四、备查文件.....	110

## 一、绪言

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》和其他有关法律法规的规定,以及《富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“合同”或“基金合同”)编写。

本招募说明书阐述了富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由国海富兰克林基金管理有限公司解释。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书做出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,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。基金投资者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。基金投资者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。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称代表如下含义：

本合同、《基金合同》	指《富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金基金合同》及其任何修订和补充
中国	指中华人民共和国（就本合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）
法律法规	指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件、地方性法规、地方政府规章及规范性文件
《基金法》	指《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》	指《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》	指《证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	指《证券投资基金信息披露管理办法》
元	指中国法定货币人民币元
基金或本基金	指依据《基金合同》所设立的富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金
招募说明书	指《富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
发售公告	指《富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金基金份额发售公告》
业务管理规则	指《国海富兰克林基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》。凡与本公司开放式基金业务相关的基金托管人、各销售机构、投资者及相关运营机构均应遵守该规则。
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
银行业监管机构	指中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构
基金管理人	指国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人	指中国农业银行
基金代销机构	指符合中国证监会规定的有关条件并与基金管理人签订了代销协议，代为办理基金销售服务业务的机构
销售机构	指基金管理人及基金代销机构
基金销售网点	指基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点
注册登记业务	指基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包 括投资者基金账户管理、基金份额注册登记、清算 及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额 持有人名册等
注册登记机构	指根据《国海富兰克林基金管理有限公司开放式基 金业务管理规则》办理本基金注册登记业务的机 构。本基金的注册登记机构为国海富兰克林基金管 理有限公司或其委托的其他符合条件的代为办理 本基金注册登记业务的机构
基金合同当事人	指受基金合同约定，根据基金合同享受权利并承担 义务的基金管理人、基金托管人、基金份额持有人
个人投资者	指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金 的自然人
机构投资者	指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在 中华人民共和国注册登记或经政府有权部门批准 设立的机构
合格境外机构投资者	指符合法律法规规定可投资于中国境内证券市场 的中国境外的机构投资者
投资者	指符合法律法规或中国证监会规定允许购买证券 投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机 构投资者和其他投资者。
基金合同生效日	基金达到法律规定及基金合同规定的条件，基金管

	理人聘请法定机构验资并办理完毕基金合同备案手续后，基金合同生效的日期
募集期	指自基金份额发售之日起不超过 3 个月
基金存续期	指基金合同生效后合法存续的不定期之期间
日/天	指公历日
月	指公历月
工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
T 日	指日常申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）
认购	指投资者在本基金募集期内购买本基金份额的行为
发售	指在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金基金份额的行为
日常申购	指基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为。本基金的日常申购自 2006 年 7 月 14 日开始办理
日常赎回	指基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为。本基金的日常赎回自 2006 年 9 月 14 日开始办理
转托管	指投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务；
交易账户	指各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户
定期定额投资计划	指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

---

基金收益	指基金投资所得股票红利、债券利息、票据投资收益、买卖证券价差、银行存款利息以及其他收益
基金账户	指注册登记机构给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的凭证
基金资产总值	指基金所购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	指基金资产总值扣除负债后的净资产值
基金份额净值	指计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数
基金资产估值	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程
指定媒体	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站
不可抗力	指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服，且在本合同由基金托管人、基金管理人签署之日后发生的，使本合同当事人无法全部履行或无法部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

本基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司，基本信息如下：

名称：国海富兰克林基金管理有限公司

住所：广西南宁市滨湖路 46 号

成立日期：2004 年 11 月 15 日

法定代表人：张雅锋

办公地址：上海浦东富城路 99 号震旦国际大楼 18 楼

注册资本：人民币 2.2 亿元

股权结构：国海证券有限责任公司持有 51% 股权，坦伯顿国际股份有限公司持有 49% 股权

电话：021-6888 0980

联系人：陈明月

截止到 2008 年 6 月 14 日，公司共有员工 91 人，其中拥有硕士以上学历的员工占 40%。所有人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。

#### （二）主要人员情况

##### 1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员基本情况

###### 董事会成员：

董事长张雅锋女士，中共党员，研究生，经济师。历任广西南方商业集团公司董事长兼总经理、党总支书记，广西壮族自治区证券办发行部主任，中国证监会南宁特派办处长、副主任等职。现任广西投资集团有限公司副总经理、国海证券有限责任公司董事长。

副董事长 Murray Lawrence Simpson 先生，大学本科学历。历任 Franklin Resources, Inc. 首席法律顾问及董事，Pasadena Capital Corporation (投资公司) Pasadena, California 副执行总裁及首席法律顾问，富兰克林邓普顿投资(亚洲)有限公司执行董事及首席行政人员。现任 Franklin Resources, Inc. 副执行总裁。

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。

董事金哲非女士，中国科技大学计算机科学学士学位和澳大利亚国立大学博士，注册金融分析师，金融风险管理师。历任澳大利亚联邦科学与工业研究机构、美国哈佛大学计算机科学家，富兰克林邓普顿投资公司高级副总裁兼资产组合分析与投资风险部环球总管。现任国海富兰克林基金管理有限公司总经理。

独立董事 Robert R. Williams 先生，硕士。历任 State Street Australia Limited, (澳洲雪梨) 执行董事, State Street Asia, 香港资深副总裁, State Street Corporation, (美国波士顿) 副行政总裁。现已退休。

独立董事平雷先生，中共党员，大学本科学历，高级工程师。历任广西壮族自治区体改委副主任、党委书记，广西壮族自治区证券管理委员会副主任，广西壮族自治区人大财经委主任委员。现已退休。

独立董事吴真先生，硕士。历任 UDI (Eisenberg Group) 美国公司对华总助，UDI (Eisenberg Group) 欧洲总部对华总助，中国欧美深圳进出口公司总助、索夫特股份有限公司董事副总经理。现任 Green View International Co., Ltd. (Thailand) 董事总裁。

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。现已退休。

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，广西证券公司稽核部总经理。现任国海证券有限责任公司稽核部总经理。

高级管理人员：

总经理金哲非女士，中国科技大学计算机科学学士学位和澳大利亚国立大学博士，注册金融分析师，金融风险管理师。历任澳大利亚联邦科学与工业研究机构、美国哈佛大学计算机科学家，富兰克林邓普顿投资公司高级副总裁兼资产组合分析与投资风险部环球总管。现任国海富兰克林基金管理有限公司总经理。

副总经理胡德忠先生，中共党员，博士，经济师。历任广西证券公司深圳营业部总经理，国海证券有限责任公司总经理助理、副总经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司副总经理。

督察长吴显玲女士，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总经理，广西证券有限责任公司副总经理，国海证券有限责任公司副总经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司督察长。

## 2、本基金基金经理

基金成立至今：张晓东先生，硕士。历任美国纽堡太平洋投资管理公司高级投资经理，阳光国际管理公司/ChinaLabs 董事，中信资本市场控股公司董事（非董事会成员），现为国海富兰克林基金管理有限公司基金经理。

## 3、本公司投资决策委员会成员的姓名和职务

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：金哲非女士（公司总经理，兼任投资决策委员会主席）；张惟闵先生（投资总监）；潘江先生（研究分析部总经理）；张晓东先生（基金经理）；朱国庆先生（基金经理）；黄林先生（基金经理）；张志强先生（风险控制经理）。督察长有权列席投资决策委员会的任何会议。

## 4、上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

- 1、办理基金备案手续；
- 2、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- 3、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的

经营方式管理和运作基金财产；

4、按照业务管理规则等业务规则办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7、依法接受基金托管人的监督；

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

10、编制季度、半年度和年度基金报告；

11、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

12、保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

13、按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

17、确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

18、组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

21、基金托管人因违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

22、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

23、基金募集期限届满未能达到基金的备案条件的,基金合同不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计在募集期内产生的利息在募集期结束后 30 天内退还基金认购人;

24、执行生效的基金份额持有人大会的决定;

25、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

26、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利,不谋求对上市公司的控股和直接管理;

27、法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### (四) 基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》(以下简称《证券法》)的行为,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《证券法》行为的发生;

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为,并承诺建立健全内部风险控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:

- (1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;
- (2) 不公平地对待管理的不同基金财产;
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

(1) 越权或违规经营；

(2) 违反基金合同或托管协议；

(3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；

(4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

(5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

(6) 玩忽职守、滥用职权；

(7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；

(9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

(10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

(11) 贬损同行，以提高自己；

(12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(13) 以不正当手段谋求业务发展；

(14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

(五) 基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

1、承销证券；

2、向他人贷款或者提供担保；

3、从事承担无限责任的投资；

4、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

5、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、

基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

- 7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 8、依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

#### （六）基金经理承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

4、不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### （七）、基金管理人的风险管理和内部控制制度

##### 1、风险管理体系

本基金在运作过程中面临的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作或技术风险、合规性风险以及其他风险。

针对上述各种风险，本公司建立了一套完整的风险管理体系，具体包括以下内容：

（1）建立风险管理环境。具体包括制定风险管理战略、目标，设置相应的组织机构，配备相应的人力资源与技术系统，设定风险管理的时间范围与空间范围等内容。

（2）识别风险。辨识组织系统与业务流程中存在的风险以及风险存在和发生的原因。

（3）分析风险。检查存在的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果。

（4）度量风险。评估风险水平的高低，既有定性的度量手段，也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一定的风险指标，测量其数值的大小。

（5）处理风险。将风险水平与既定的标准相对比，对级别较低的风险加以监控，对较为严重的风险实施一定的管理计划，对于后果极其严重的风险，则及

时准备相应的应急处理措施。

(6) 监视与检查。对已有的风险管理系统要监视及评价其管理绩效，在必要时加以改变。

(7) 报告与咨询。建立风险管理的报告系统，使公司股东、公司董事会、公司高级管理人员及监管部门及时了解公司风险管理状况，并向其寻求咨询意见。

## 2、内部控制制度

### (1) 内部控制的原则

①全面性原则。内部控制制度覆盖公司的各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节。

②独立性原则。公司设立独立的督察员与监察稽核部门，并使它们保持高度的独立性与权威性。

③相互制约原则。公司部门和岗位的设置权责分明、相互牵制，并通过切实可行的相互制衡措施来消除内部控制中的盲点。

④重要性原则：公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上，内部风险控制与公司业务发展同等重要。

### (2) 内部控制的主要内容

基金管理人内部控制的主要内容包括：业务控制、资金管理控制、会计系统控制、信息技术系统控制、信息披露控制、监察稽核控制、人事控制等。

#### ①业务控制

业务控制包括市场开发业务控制、投资管理业务控制、开放式基金业务控制、金融创新业务控制等。

市场开发业务控制主要包括：针对市场开发的各项业务建立明确的职责分工，实行岗位分离制度，保证各项业务的有效性和可靠性，同时加强内部牵制，防止错误及舞弊行为发生；制定基金销售的标准化流程，选用先进的电子销售系统，以不断提高基金销售的服务质量和避免差错事故的发生；制定统一的客户资料和销售资料管理制度，妥善保管各类资料；实施对客户的审查制度，对客户情况及资金情况进行严格的审查，事先明确双方的权利与义务，防范新的电子交易方式下的各种风险，对越权销售、销售的注销进行严格审核和控制。

研究业务控制主要内容包括：研究工作保持独立、客观；建立了严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立了投资对象备选库制度，研究部门根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护备选库；建立了投资分析例会制度，沟通信息，交流经验，研究对策，提高投资决策的准确性和及时性；建立了研究报告质量评价体系。

投资决策业务控制主要内容包括：投资决策严格遵守法律法规的有关规定，符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求；明确界定投资权限，严格遵守投资限制，防止越权决策；建立了投资决策审批制度。投资决策委员会负责审核基金经理提出的资产配置计划，包括各种证券各种的持仓比例以及行业分布比例。基金经理按经审核同意的投资方案开展业务，不做出超过其授权范围的投资决策；建立了投资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策；建立了科学的投资管理业绩评价体系，包括投资组合情况、是否符合基金产品特征和决策程序、基金绩效归属分析等内容。

基金交易业务控制主要内容包括：基金交易实行集中交易制度，基金经理不直接向交易员下达投资指令或者直接进行交易；制定了基金投资交易业务的标准化流程并注意流程在各部门之间的衔接和监控，并有书面凭证；建立了交易员交易上限控制制度。中央交易室针对个别交易员的从业经验及能力设置相应交易限额，交易限额在交易系统上设定并由交易系统自动监控，以避免因交易员经验不足、执行交易量过大等因素对交易执行质量可能造成的不良影响；建立了完善的交易记录制度，每日投资组合列表等及时核对并存档保管。

## ②资金管理控制

资金管理控制主要内容包括：基金资金独立于基金管理人的自有资金。基金管理人的自有资金与基金资金分开并互为封闭，不相互转款、拆借、垫付，不混合使用；坚持了资金营运安全性、流动性和效益性相统一的经营原则。资金的筹措和使用严格按照法律法规及基金管理人有关规定执行并统一管理，以提高资金使用效益，并注意其安全性和流动性；建立资金的预算审核控制。基金管理人定期编制资金的预算计划，以便在一定期限内对资金统筹安排。资金预算应突出重点，确保重要业务的开展，兼顾一般，压缩非业务性资金支出。

## ③会计系统控制

基金管理人采取了适当的会计控制措施，明确会计凭证、会计账簿和财务会计报告的处理程序，以确保基金管理人会计核算系统的正常运转。具体内容包括：基金管理人建立了凭证制度，通过凭证设计、登录、传递、归档等一系列凭证管理制度，确保正确记载经济业务，明确经济责任；基金管理人建立了账务组织和账务处理体系，正确设置会计账簿，有效控制会计记账程序；基金管理人建立了复核制度，通过会计复核和业务复核防止会计差错的发生。

#### ④信息技术系统控制

信息技术系统的设计开发符合国家、金融行业软件工程标准的要求，编写了完整的技术资料；在实现业务电子化时，设置保密系统和相应控制机制，并保证了信息技术系统的可稽核性；信息技术系统投入运行前，已经过业务、运营、监察稽核等部门的联合验收。

#### ⑤信息披露控制

信息披露控制包括：基金管理人按照《中华人民共和国公司法》、《证券法》、《基金法》、《信息披露办法》及其配套的信息披露内容与格式准则和编报规则等法律法规和中国证监会有关规定，建立完善的信息披露制度，能够保证公开披露的信息真实、准确、完整、及时；基金管理人公开披露的信息包括：招募说明书；基金合同；托管协议；定期报告；临时报告；法律法规以及中国证监会规定应予以披露的其他信息。基金管理人严格执行信息披露的作业流程，各部门各司其职，并承担其相应的责任。

#### ⑥监察稽核控制

监察稽核控制包括：基金管理人设立了督察长，全权负责基金管理人的监察稽核工作。督察长的任命符合中国证监会的任职条件，经董事会聘任，报中国证监会核准。督察长对董事会负责，任期由基金管理人章程规定；根据基金管理人监察稽核工作的需要和董事会授权，督察长可以列席基金管理人相关会议，调阅基金管理人相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。督察长对于在稽核监察中所掌握的信息资料负有保密责任。督察长定期和不定期向董事会报告基金管理人内部控制执行情况，董事会对督察长的报告进行审议；督察长独立出具监察季报及其他报告，直接报送董事会和中国证监会，同时抄送总经理。如发现基金管理人重大违规行为，立即向基金管理人的董事

长和中国证监会报告。

#### ⑦人力资源管理控制

人力资源管理控制包括：本基金管理人建立了合理的员工报酬体系，合理确定员工报酬水平。过低的报酬会影响人力资源的质量和运行效益，而过高的报酬会损害基金管理人的利益，所以确定工资制度时坚持了效益优先，兼顾公平的原则；基金管理人建立了管理人员的选聘和培养制度。制定科学的管理人员选聘政策和方法，使优秀人才脱颖而出；制定管理人员培养制度，不断提高其管理水平；制定了员工的业绩评价和激励方案，充分调动了其积极性。

#### ⑧内幕交易和关联交易控制

内幕交易和关联交易控制包括：严格规范和界定禁止员工从事的活动，并要求员工严格遵守；完善电脑监控系统，在线实时监控基金的投资、交易活动，防止利用基金资产对敲作价等操纵市场的行为，尤其注意观察大额买卖股票的现象；设置投资限制表。按内幕交易的明确规定限制买卖的股票，对限制表中的股票严禁购买，监察稽核部门根据限制表监控基金投资；对员工行为进行监察，防止出现与基金从业人员操守不符的行为，以及有关法律法规禁止基金从业人员从事的行为；对员工加强职业道德教育。

实现集中交易制度、防火墙制度、信息控制制度，从制度上防止内幕交易的发生。

### 3、基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本公司确知建立、实施和维持内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任；

(2) 上述关于内部控制的披露真实、准确；

(3) 本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 四、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

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦

法定代表人：项俊波

成立时间：1979 年 2 月 23 日

注册资金：361 亿元人民币

存续期间：持续经营

电话：68424199

联系人：李芳菲

中国农业银行是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。在国内，中国农业银行网点遍布城乡，资金实力雄厚，服务功能齐全，不仅为广大客户所信赖，而且与他们一道取得了长足的共同进步，已成为中国最大的银行之一。在海外，农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，被《财富》评为世界 500 强企业之一。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。中国农业银行自 1979 年恢复成立以来，在社会各界的大力支持下，全行员工开拓创新，奋力拼搏，在建设现代商业银行的征途上，积极探索，勇于实践，资金实力显著增强，业务领域不断拓宽，经营结构逐年优化，财务收益大幅跃升，管理水平不断提高，在支持国民经济发展、为客户提供优质服务的同时，自身不断成长壮大。

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、综合管理处、风险管理处、境外资产托管处，拥有先进的安全防范设施和基金清算、核算、交易监督快捷处理系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 70 名，其中硕士与博士 36 人，高级会计师、高级经济师、高级工程师 10 余名，服务团队成员都具有高素质高学历的托管业务能力，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称。

### (2) 基金托管业务经营情况

截止 2008 年 3 月 31 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 54 只，包括基金裕阳、基金裕隆、基金汉盛、基金景福、基金天华、基金鸿阳、基金丰和、基金久嘉、富国动态平衡开放式基金、长盛成长价值开放式基金、宝盈鸿利收益开放式基金、大成价值增长开放式基金、大成债券开放式基金、银河稳健开放式基金、银河收益开放式基金、长盛债券开放式基金、长信利息收益开放式基金、长盛动态精选开放式基金、景顺长城内需增长开放式基金、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基金、富国天瑞强势开放式基金、鹏华货币市场基金、国联分红增利开放式基金、国泰货币市场基金、新世纪优选分红证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金（LOF）、信诚四季红混合型证券投资基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、富国天时货币市场基金、益民货币市场基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心精选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、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、大成积极成长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、宝盈策略增长股票型证券投资基金、泰达荷银首选企业股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金，国泰金

牛创新成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、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、华夏复兴基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金，托管基金份额 2814 亿份。

## （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

风险与内控管理委员会直接负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。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，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

### 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。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

1、直销机构：国海富兰克林基金管理有限公司  
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：张雅锋  
电话：021-6888 0980  
传真：021-6887 0708  
客服电话：021-3878 9555  
联系人：庞大文  
公司网址：WWW.FTSFUND.COM

### 2、代销机构：

#### （1）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：北京市海淀区西三环北路 100 号金玉大厦  
法定代表人：项俊波  
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  
法定代表人：姜建清  
电话：010-66107900  
传真：010-66107914  
客户服务热线：95588  
联系人：田耕

公司网站：[www.icbc.com.cn](http://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

统一客户服务电话：95566

公司网站：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

(4) 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：010-6554 2337

传真：010-6554 1281

联系人：王斌

客服电话：95558

公司网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

(5) 国海证券有限责任公司

注册地址：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅锋

电话：0771-5539262

传真：0771-5539033

联系人：覃清芳

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

(6) 齐鲁证券有限责任公司

注册地址：山东省济南市经十路 128 号

办公地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

开放式基金咨询电话：0531-82024184

联系人：傅咏梅

网址：[www.qlzq.com.cn](http://www qlzq.com.cn)

(7) 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：祝幼一

客户服务热线：4008888666

网址：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(8) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

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：金芸、李笑鸣

客服电话：400-8888-001、021-962503 或拨打各城市营业网点咨询电话

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

(9) 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：肖时庆

客户服务电话：4008-888-888

电话：010-6656 8047

联系人：李洋

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

(10) 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：上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 22 楼

法定代表人：兰荣

客服电话：021-68419393 转 1098

联系人：谢高得

业务联系电话：021-68419974

业务联系人：杨盛芳

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

(11) 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

联系人：邓寒冰

网址：[www.sywg.com.cn](http://www.sywg.com.cn)

(12) 联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南东路 5047 号发展银行大厦 10、24、25 楼

法定代表人：马昭明

电话：0755—82492000

传真：0755-82492962

客户服务电话：400-8888-555，0755-25125666

联系人：盛宗凌

网址：[www.lhzq.com](http://www.lhzq.com)

(13) 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：黄健

客户服务热线：95565、4008888111

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

（14）中信建投证券有限责任公司

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

法定代表人：张佑君

电话：400 8888 108（免长途费）；

开放式基金业务传真：（010）65182261

开放式基金清算传真：（010）65183880

联系人：权唐

公司网站：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

（15）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

营业网点（北京）：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

电话：（010）66045522

传真：（010）66555500

客户服务电话：010-66045678

联系人：陈少震

公司网站：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)、[www.txjijin.com](http://www.txjijin.com)

（16）山西证券有限责任公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：吴晋安

联系人：张治国

联系电话：0351-8686703

传真：0351-8686709

网址：www.i618.com.cn

（17）广发证券股份有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 36、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

电话：020-87555888-875

开放式基金咨询电话：（020）87555888 转各营业网点

联系人：肖中梅

网址：www.gf.com.cn

（18）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：蒋永明

电话：（0731）4403343

传真：（0731）4403439

联系人：郭磊

客户服务热线：（0731）4403343

网址：www.cfzq.com

（19）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：潘锴

电话:85096709

客户服务电话:0431-96688-0

网址: [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

(20) 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: 胥春阳

传真: 025-83320066

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

(21) 中信金通证券有限责任公司

住所: 杭州市中河南路11号万凯商务楼A座

办公地址: 杭州市中河南路11号万凯商务楼A座

法定代表人: 刘军

联系人: 王勤

联系电话: 0571-85783715

传真: 0571-85783771

网址: [www.96598.com.cn](http://www.96598.com.cn)

客户服务热线: 0571-96598

(22) 华泰证券有限责任公司

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: 025-84457777-248

联系人: 张小波

客户咨询电话: 025-84579897

全国客户服务电话: 4008-888-168

(23) 湘财证券有限责任公司

地址：长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

法定代表人：陈学荣

电话：021-68634518

传真：021-68865938

联系人：陈伟 021-68634818-8631

客服电话：400-888-1551

公司网站：www.htsc.com.cn

(24) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82825555

传真：021-68801119

基金业务联系人：张勤

联系电话：021-68801217

公司网站：www.essences.com.cn

(25) 江南证券有限责任公司

注册地址：南昌市抚河北路291号

通讯地址：南昌市抚河北路291号五楼

法定代表人：姚江涛

电话：0791-6768763

传真：0791-6789414

联系人：余雅娜

客户咨询电话：0791-6768763

公司网站：www.scstock.com

(26) 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：0551-2207008

传真：0551-2207965

联系人：李纯刚

全国统一热线：4008888777，安徽省内热线96888

公司网站：www.gyzq.com.cn

(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：张雅锋

电话：021-6888 0980

联系人：庞大文

(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14楼

办公地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

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、吕红

(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

住址：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：汪棣 单峰

## 六、基金的募集

本基金募集期为 2006 年 5 月 10 日至 6 月 9 日，募集的净销售额为 2,912,150,781.80 元人民币，认购款项在募集期间产生的银行利息共计 830,670.48 元人民币，募集有效认购总户数为 93,747 户，按照每份基金份额 1.00 元人民币计算，本基金在募集期募集的有效认购份额为 2,912,150,781.80 份，利息结转的基金份额为 830,670.48 份，两项合计共 2,912,981,452.28 份基金份额，已全部计入投资者基金账户，归投资者所有。

## 七、基金合同的生效

### （一）基金合同生效

经中国证券监督管理委员会核准，本基金合同已于 2006 年 6 月 14 日正式生效。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金额

本基金合同生效后，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续 20 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回的场所

本基金的申购和赎回将通过本基金管理人的直销网点及基金代销机构的代销网点进行。

本基金的销售机构包括国海富兰克林基金管理有限公司及其委托的代销机构。目前的代销机构为中国农业银行、国海证券、齐鲁证券、国泰君安证券、海通证券、银河证券、兴业证券、申银万国证券、联合证券、招商证券、中信建投证券、天相投资顾问有限公司、山西证券、广发证券、南京证券、东北证券和财富证券等代销机构。

基金管理人可以根据情况变更或增减代销机构，并另行公告。

销售机构可以根据情况变更或增减其销售城市（网点），并另行公告。

投资者也可通过本基金管理人或者指定基金代销机构提供的其他方式（例如：电话、传真或网上交易）办理基金的申购与赎回。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

本基金的开放日是指为投资者办理基金申购和赎回等业务的证券交易所交易日（基金管理人根据法律法规或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外）。开放日具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。

基金投资者在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整不应影响投资者利益造成实质影响并应报中国证监会备案，并在实施日 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

#### 2、申购的开始时间及业务办理时间

本基金合同生效后不超过 3 个月时间内开始办理申购。具体业务办理时间在

开放申购公告中规定。

### 3、赎回的开始时间及业务办理时间

本基金合同生效后不超过3个月时间内开始办理赎回。具体业务办理时间在开放赎回公告中规定。

4、在确定申购开始时间和赎回开始时间后，由基金管理人最迟于开放日前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### （三）申购和赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、当日的申购和赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施3个工作日前在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### （四）申购和赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

本基金的申购和赎回采取书面形式、电话、或销售机构同意的其他交易形式。基金投资者必须按销售机构规定的手续向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者申购本基金，须按销售机构规定的方式备足申购资金，否则所提交的申购申请无效而不予成交。

投资者申请赎回时，其在销售机构必须有足够的基金份额余额，否则所提交的赎回申请无效而不予成交。

#### 2、申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，本基金注册登记机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资者可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购和赎回的成交情况。

#### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成功后，基金管理人在 T+7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

#### （五）申购和赎回的数额约定

1、代销网点、直销网上交易的投资者每次申购本基金的最低金额为 1,000 元（含申购费）。直销柜台网点投资者首次申购本基金的最低金额为 100,000 元（含申购费），追加申购的最低金额为 1,000 元，已在直销柜台网点有该基金认购记录的投资者不受首次申购最低金额的限制。代销网点的投资者欲转入直销柜台网点进行交易要受直销柜台网点最低金额的限制。投资者当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整本基金首次申购的最低金额。

2、基金份额持有人在销售机构赎回时，每次对本基金的赎回申请不得低于 1,000 份基金份额。基金份额持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的基金份额余额不足 1,000 份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可以根据实际情况对以上限制进行调整，最迟在调整生效前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

4、申购份额及余额的处理方式：本基金的申购有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，计算结果保留到小数点后 2 位，第 3 位四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

5、赎回金额的处理方式：本基金的赎回金额按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，计算结果保留到小数点后 2 位，第 3 位四舍五入，由此产生的误差在基金财产中列支。

6、基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

#### （六）申购费率和赎回费率

##### 1、申购费

（1）投资者在申购本基金时需交纳申购费用。按申购金额采用比例费率。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

申购金额（含申购费）	费率
------------	----

100 万以下	1.50%
100 万(含)-500 万	1.20%
500 万（含）-1000 万	1.00%
1000（含）万以上	1000 元/笔

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

## 2、赎回费

本基金赎回费具体费率如下：

持有时间	费率
1 年以下	0.60%
1 年（含 1 年）至 2 年	0.30%
2 年（含 2 年）至 3 年	0.10%
3 年（含 3 年）以上	0

3、本基金的申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。在法律法规规定的限制内，基金管理人可决定实际执行的申购、赎回费率，并在《招募说明书》中进行公告。基金管理人认为需要调整费率时，应最迟于新的费率开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### （七）赎回费的归属

本基金赎回费的 25% 归入基金财产，其余部分作为注册登记等其他必要的手续费。

### （八）申购份额和赎回金额的计算

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）；

申购费用=申购金额-净申购金额；

申购份额=净申购金额/T 日基金份额净值。

其中，申购金额包括净申购金额和申购费用。

例二：假定 T 日本基金的份额净值为 1.2000 元，三笔申购金额分别为 1 万元、100 万元和 500 万元，则各笔申购负担的申购费用和获得的该基金份额计算如下：

	申购 1	申购 2	申购 3

申购金额（元，A）	10,000	1,000,000	5,000,000
适用申购费率（B）	1.50%	1.20%	1.00%
净申购金额（ $C = A/(1+B)$ ）	9,852.22	988,142.29	4,950,495.05
申购费（ $D=A-C$ ）	147.78	11,857.71	49,504.95
申购份额（ $E=C/1.2000$ ）	8210.18	823,451.91	4,125,412.54

## 2、赎回金额的计算

赎回金额计算方法如下：

赎回总额 = 赎回份额 × T 日基金份额净值

赎回费用 = 赎回总额 × 赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

例三：假定某投资者在 T 日赎回 10,000 份，该日该基金份额净值为 1.2500 元，其在认购/申购时已交纳认购/申购费用，持有年限不足 1 年，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用

$= 10,000 \times 1.2500 - 10,000 \times 1.2500 \times 0.6\% = 12,425$  元

3、基金份额净值的计算公式为：基金份额净值 = 基金资产净值总额 / 发行在外的基金份额总数。

本基金 T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### （九）申购和赎回的注册登记

投资者申购基金成功后，注册登记机构在 T+1 日自动为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金成功后，注册登记机构在 T+1 日自动为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### （十）暂停申购的情形及处理方式

除出现如下情形，基金管理人不得暂停基金投资者的申购申请：

- (1) 不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- (2) 证券交易场所在交易时间非正常停市，导致无法计算当日的基金净值；
- (3) 基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- (4) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他可暂停申购的情形；
- (5) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购。

发生上述(1)到(4)项暂停申购情形时，基金管理人应当在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登暂停申购公告。

#### (十一) 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

本基金必须保持足够的现金或者到期日在一年内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。除出现如下情形，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项：

- (1) 不可抗力的原因导致基金无法正常工作；
- (2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日基金资产净值无法计算；
- (3) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- (4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能支付的，可支付部分按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。同时在出现上述第(3)款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过正常支付时间20个工作日，并在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登暂停赎回公告。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。

## （十二）巨额赎回的认定及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

本基金在单个开放日内，基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10% 时，即认为发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据当时市场和本基金的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于基金总份额的 10% 的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时明确做出不参加顺延下一个开放日赎回的表示外，自动转为下一个开放日赎回处理。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权并将以下一个开放日的基金份额净值为准进行计算，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

（3）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人通过指定媒体、基金管理人的公司网站或销售代理人的网点刊登公告，或邮寄、传真等方式，在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法。

本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

## （十三）重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天，第二个工作日基金管理人应在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告并公布最近一个开放日本基金的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前一个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每至少两周重复刊登暂停公告一次。基金重新开放申购和赎回时，基金管理人应提前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上连续刊登该基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

#### （十四）基金的转换

为方便基金份额持有人，未来在各项技术条件和准备完备的情况下，投资者可以选择在本基金和本基金管理人旗下其他基金（如有）之间进行基金转换。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定可以由基金管理人届时另行规定。

#### （十五）转托管

本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个交易账户转入另一个交易账户进行交易。

进行份额转托管时，投资者可以将其某个交易账户下的基金份额全部或部分转托管。办理转托管业务的基金份额持有人需在转出方办理基金份额转托管手续。对于有效的转托管申请，转出的基金份额将在投资者办理转托管手续后转入其指定的交易账户。具体办理方法参照“业务管理规则”的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

#### （十六）定期定额投资业务

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资业务，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资者在办理定期定额投资业务时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### （十七）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行及经注册登记机构认可的其他情况下产生的非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指受理基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，按基金注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

#### （十八）基金的冻结

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结。

## 九、基金的投资

### （一）投资目标

本基金以富兰克林邓普顿基金集团环球资产管理平台为依托，在充分结合国内新兴证券市场特性的原则下，通过主要投资于具有独特且可持续竞争优势、未来收益具有成长性的上市公司股票，辅助投资于资产价值低估的上市公司股票，以达到基金财产长期增值的目的。

### （二）投资范围

本基金的投资范围为国内依法公开发行的股票、债券以及中国证券监督管理委员会允许基金投资的其他金融工具，其中，股票投资范围包括所有在国内依法公开发行上市的 A 股；债券投资范围包括国内国债、金融债、企业债和可转换债券等。

本基金投资组合的范围为：股票资产占基金资产的 60%—95%，债券、现金类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 5%—40%，其中，基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金的股票投资主要集中于具有良好品质并具有良好的成长性的上市公司，辅助投资于资产价值低估的上市公司，而资产价值低估的机会可在全流通的市场条件下通过企业重组和收购兼并来实现。具有成长性和资产价值低估的上市公司的投资比例将不低于本基金股票资产的 80%。

### （三）投资理念

一般而言，市值相近的上市公司在股价的表现上具有一定的相似性，但真正支持股价持续表现的因素，并非市值大小而是上市公司自身具有的增长潜力。因此深层发掘上市公司的增长潜力，辅以市值板块的属性特征，将能有效捕捉股价或未来收益的增长。

### （四）投资策略

本基金投资组合管理流程主要包括“自下至上”的选股计划和“自上至下”的选债计划两个方面。

具体分解为如下几个环节：

## 1、确定资产配置

一般情况下，投资决策委员会负责基金财产的配置策略，并采用资产配置分析会的形式来实施，以资产配置分析会的组织形式保证资产配置决策的正确性和科学性。资产配置分析会由投资总监主持，基金经理和研究部总监参加。

在具体的资产配置过程中，本基金采用“自下而上”的资产配置方法，从上市公司的具体发展前景和未来的盈利分析，到行业的发展趋势，再到宏观经济形势，确定大类资产的配置。

在运用了“自下而上”策略之后，根据市场环境的变化、市场出现的各种套利机会和未来的发展趋势判断，确定本基金财产配置最终的选择标准。

同时，在股票组合的构建中，充分、及时地利用好证券市场出现的各种投资机会，按照市值属性进行配置，在正常的市场环境下，本基金投资于大市值上市公司的比例占本基金股票资产的 20%-100%（与下同），中市值上市公司的比例为 0%-70%，小市值的比例为 0%-40%。

划分市值时，基金管理人每季度将中国 A 股市场中的所有上市公司，按其总市值由大至小排列，并计算各公司所对应的累计总市值占全部公司累计总市值的百分比，将所对应的累计总市值百分比处在[0%,40%]的公司定义为大市值公司，在[40%,70%]的公司定义为中市值公司，在[70%,100%]的公司定义为小市值公司。若因新股发行等因素导致 A 股市场市值规模分布发生较大变动，并因而导致本基金股票组合在大、中、小市值公司的投资超出上述配置比例时，本基金将根据市场情况，本着基金持有人利益最大化原则，适时予以调整，调整期限最长不超过一年。

## 2、股票选择

本基金在学习和借用富兰克林邓普顿基金集团弹性市值基金管理经验的基础上，创造性地科学制定规范的股票选择流程，该选择流程包括如下步骤：

### （1）检验所有 A 股

通过定性和定量方法全面研究中国股市整体状况，在分析经济周期的影响和各行业投资机会时，横跨三种不同的市值大小，力争寻找各行业中最好的机会，形成初级股票池。

### （2）鉴别成长驱动因子

在形成初级股票池后进行上市公司成长的驱动因子分析，以进一步寻找能推动企业未来收益增长的驱动因子。其中，独特的产品领域、特有的生产技术、出色的财务状况、良好的企业管理和领先的行业地位都是蕴涵增长潜能的竞争优势，也就是所谓的成长驱动因子。具体操作上，本基金将那些在一个或者多个驱动因子方面具有明显优势的上市公司选择出来以形成次级股票池。并不要求进入初级股票池的所有股票同时具备四个驱动因子的全部条件，本基金管理人将根据具体的上市公司的实际情况深入挖掘其具有的成长驱动因子。

(3) 评估成长潜力和风险。本基金考察的财务风险指标主要包括长期负债权益比率、资产负债率、长期负债资产比率；经营风险指标主要包括主营收入增长率、净利润增长率、总资产增长率、固定资产增长率、股东权益增长率、主营利润增长率等；此外，如上市公司的应收账款周转率、获利能力、偿债能力、高级管理人员的信用记录、操作品性评估等指标也是上市公司经营风险分析的主要内容。

(4) 利用三层次分析方法有效把握股票的成长性机会和特殊情况下的市场机会

本基金重点关注和选择具有成长性的股票，那些收益增长潜力尚未完全反映在目前股价上的股票构成了我们投资组合的基础，在此基础上，我们根据市场机会的变化，捕捉套利性和特殊性机会，以降低基金的整体风险并提升基金的超额收益。

### 3、债券投资策略

本基金的债券投资为股票投资由于市场条件所限，不易实施预定投资策略时，使部分资产保值增值的防守性措施。

#### (五) 投资程序

投资决策是投资运作的重要环节，通过对不同层次的决策主体明确授权范围，建立公司投资决策运作体系

(1) 投资决策委员会会议：公司的最高投资决策层，对投资总监提交的投资策略和资产配置进行讨论，并对重大投资决策做出决定。

(2) 投资组合管理会议：由投资总监主持，基金经理和研究部总监参加。按照投资决策委员会决议，根据最新的市场动态以及来自分析员的最新推荐，评估

投资组合的构成以及资产配置和投资策略。风险控制经理将从风险预测和策略有效性的角度提出建议。当观点达成一致时，对投资组合的调整才能够付诸实施。投资总监在没有统一意见的情况下做出最终决策。

(3) 股票购买清单审议会议：由投资总监主持，基金经理和研究分析部研究员参加会议。审议研究员提出的公司分析报告，确定进入或剔除出股票购买清单的股票名单。

(4) 基金经理根据投资组合管理会议的资产配置指令和购买清单审议会议作出的结论构建投资组合。在构建投资组合的过程中，基金经理必须严格遵守基金合同的投资限制及其他要求，同时其对组合调整的幅度必须在被授权的范围内进行。

(5) 风险管理和业绩分析报告会：风险控制经理提供最新的风险管理和业绩分析报告。针对现有的投资组合，所有的风险控制规则都需要得到检验，从而保证在投资框架允许的范围内进行投资。

(6) 基金经理根据风险管理和业绩分析定期报告，以及最新信息和研究结果做出投资组合的适当调整。本基金投资策略由“自下而上”的选股计划和“自上至下”的选债计划组成。

由投资总监主持的投资组合管理会议向投资决策委员会提出投资策略和资产配置议案。经投资决策委员会批准的决议方案交由基金经理执行。基金经理从股票备选清单中选取股票，再并入债券经理提供的债券，构建投资组合。基金经理对证券交易的决策通过中央交易室执行。

下图是本基金的投资框架结构。

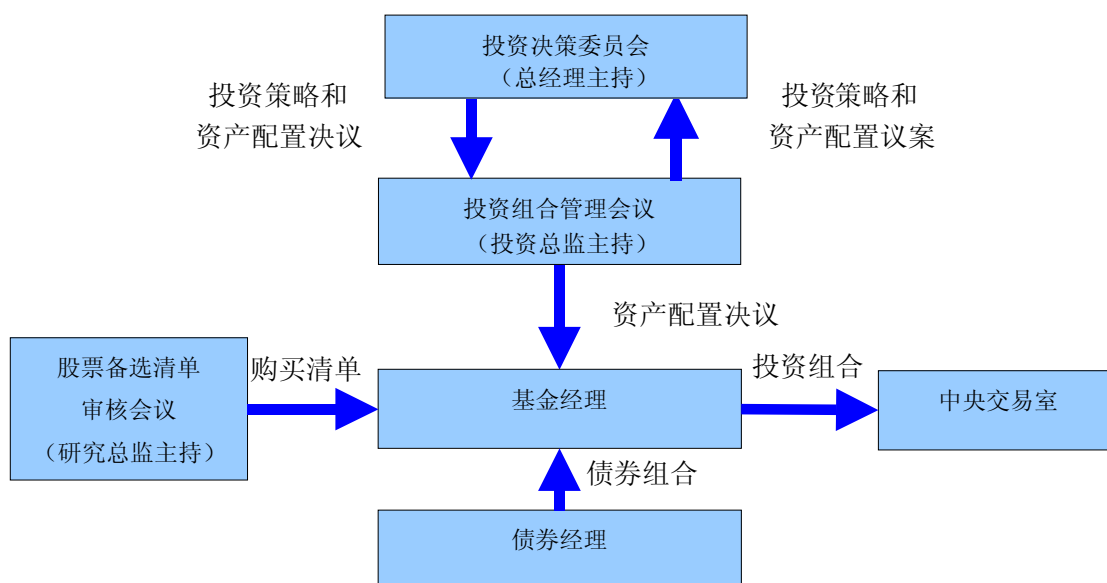


图 3：本基金投资框架

“自下至上”的选股计划：从企业层面出发，通过对投资对象深入、系统的分析来挖掘上市公司的内在价值，积极寻求价值被低估的证券。

“自上至下”的选债计划：在研判宏观经济趋势、货币政策、利率期限结构变化及信用状况的基础上做出最佳的资产配置及风险控制。

#### （六）投资限制

- 1、本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- 2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- 3、本基金财产参与股票发行申购，基金所申报的金额不超过该基金的总资产，基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 4、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定；
- 5、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定。

#### （七）投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

#### （八）风险管理

风险控制是投资管理的重要组成部分，有效防范和化解投资风险是切实保护

基金份额持有人利益的重要举措。

风险控制经理负责公司投资组合风险控制平台的运作。本基金组合风险控制平台建立于富兰克林邓普顿的风险控制平台之上，以保护基金份额持有人利益为风险管理的最高准则。

本基金风险管理主要工具是“国海富兰克林基金风险管理及绩效评估系统”。该风险管理系统包括市场风险管理、流动性风险度量、风险的多因素模型分析(股票和债券分析)及投资组合绩效评估等模块。

#### (九) 业绩评价基准

本基金的整体业绩比较基准指数为：

70% X MSCI 中国 A 股指数+ 25% X 新华雷曼中国国债指数+ 5% X 同业存款利率

MSCI 中国 A 股指数衡量股票投资部分的业绩，新华雷曼中国国债指数衡量基金债券投资部分的业绩。

MSCI 中国 A 股指数具有市场代表性强、指数编制方法透明、样本股票调整规则清晰、市场波动较小等特征，所以本基金选择 MSCI 中国 A 股指数衡量股票投资部分的业绩。

新华雷曼中国国债指数是业内最常用的一种评判债券投资收益的基准指数之一，由于其权威性、便利性、及时性的特点，本基金债券部分的业绩比较基准选择新华雷曼中国国债指数。

随着国内证券市场的逐步成熟和监管部门监管效果的出现，如果法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金将严格按照管理层的要求，在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

#### (十) 基金管理人代表基金份额持有人利益行使股东权利及因基金财产投资于证券所产生的其他权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定，以基金管理人的名义，代表基金份额持有人利益行使股东权利及因基金财产投资于证券所产生的其他权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### (十一) 基金的融资

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资。

#### (十二) 基金投资组合报告

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2008年4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止2008年3月31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

项目名称	项目市值 (人民币元)	占基金资产总值比例
股票	6,955,298,467.50	84.94%
权证	0.00	0.00%
债券	199,560,000.00	2.44%
资产支持证券	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金合计	973,155,422.21	11.88%
其他资产	60,848,582.46	0.74%
资产总值	8,188,862,472.17	100.00%

#### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	市值（人民币元）	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	<b>0.00%</b>
B 采掘业	1,169,915,311.89	14.54%
C 制造业	2,289,621,678.93	28.45%
C0 食品、饮料	147,433,215.53	1.83%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	1,051,906,484.75	13.07%
C5 电子	55,029,416.45	0.68%
C6 金属、非金属	537,859,882.60	6.69%
C7 机械、设备、仪表	205,408,959.00	2.55%
C8 医药、生物制品	291,983,720.60	3.63%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	684,627,905.01	8.51%
E 建筑业	57,676,914.24	0.72%
F 交通运输、仓储业	112,534,366.50	1.40%
G 信息技术业	361,019,064.80	4.49%
H 批发和零售贸易	575,703,243.69	7.16%
I 金融、保险业	1,232,372,419.34	15.32%
J 房地产业	397,277,158.40	4.94%
K 社会服务业	74,550,404.70	0.93%
L 传播与文化产业	0.00	0.00%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	6,955,298,467.50	86.46%

### 3. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

股票代码	股票名称	数量	市值(人民币元)	市值占基金资产净值比例
000792	盐湖钾肥	8,500,067	727,605,735.20	9.04%

600694	大商股份	11,219,085	495,771,366.15	6.16%
600900	长江电力	34,918,575	490,605,978.75	6.10%
000002	万科A	15,518,639	397,277,158.40	4.94%
600718	东软股份	11,033,590	361,019,064.80	4.49%
600036	招商银行	11,213,000	360,722,210.00	4.48%
600583	海油工程	7,481,052	340,387,866.00	4.23%
600348	国阳新能	8,857,839	306,215,494.23	3.81%
600660	福耀玻璃	11,207,089	302,591,403.00	3.76%
000963	华东医药	20,418,442	291,983,720.60	3.63%

## 4. 报告期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	债券市值（人民币元）	市值占基金资产净值比例
金融债投资	199,560,000.00	2.48%
债券投资合计	199,560,000.00	2.48%

## 5. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

债券代码	债券名称	市值（人民币元）	市值占基金资产净值比例
070217	07 国开 17	199,560,000.00	2.48%

## 6. 投资组合报告附注

- 1). 本基金本期投资的前十名证券中，无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。
- 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：

其他资产	金额（人民币元）
交易保证金	1,000,000.00
应收利息	4,166,151.85
应收申购款	55,682,430.61
合计	60,848,582.46

## 4). 报告期内本基金投资权证情况：

途径	权证代码	权证名称	数量
老股东配售 08 中石化债派发权证	580019	石化 CWB1	762,045

- 5). 截至报告期末，权证石化 CWB1 已卖出，报告期末本基金未持有权证。
- 6). 报告期末本基金未持有处于转换期的可转换债券。
- 7). 截至报告期末，本基金未投资资产支持证券。

## 十、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。

截止到 2008 年 3 月 31 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
2006年6月14日 — 2006年12月 31日	50.08%	1.13%	38.64%	0.97%	11.44%	0.16%
2007年1月1日 — 2007年12月 31日	164.34%	2.06%	95.25%	1.61%	69.09%	0.45%
2008年1月1日 — 2008年3月31 日	-18.48%	2.12%	-19.19%	2.01%	0.71%	0.11%
2006年6月14日 — 2008年3月31 日	223.42%	1.84%	118.76%	1.51%	104.66%	0.33%

## 十一、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、清算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、其他投资及其估值调整；
- 9、其他资产等。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

其构成主要有：

- 1、基金份额持有人申购基金份额所支付的款项；
- 2、运用基金财产所获得收益（亏损）；
- 3、以前年度实现的尚未分配的收益或尚未弥补的亏损。

### （三）基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和“富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金”联名的方式开立基金证券账户、以“富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金”的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的保管和处分

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。

3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

4、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

5、基金管理人、基金托管人可以按基金合同的规定，收取管理费、托管费及其他费用。

6、除法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

## 十二、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金相关金融资产的公允价值，并为基金份额提供计价依据。

### （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日，以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### （三）估值对象

基金依法拥有的股票、债券、权证及其他基金资产。

### （四）估值方法

#### 1、股票估值方法：

（1）上市流通股股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

#### （2）未上市股票的估值：

① 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

② 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

③ 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

④ 非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

（3）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管

理人认为按本项第（1）—（2）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2、债券估值方法：

（1）在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（3）首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（4）交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

（5）在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

（6）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（7）在任何情况下，基金管理人如采用本项第（1）—（6）小项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第（1）—（6）小项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，基金管理人可根据具体情况与基金托

管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(8) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 3、权证估值办法：

(1) 基金持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4) 在任何情况下，基金管理人如采用本项第(1)－(3)项规定的方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按本项第(1)－(3)项规定的方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况，并与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### 4、其他有价证券等资产按国家有关规定进行估值。

#### (五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### (六) 估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

## 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人或注册登记机构或代销机构或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方；

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人的行为造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人的行为造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人、基金托管人及基金销售机构之外的第三方造成基金财产损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向有责任的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

(7) 按法律法规规定的其它原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法

(1) 当基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当错误达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理公司应当及时通知基金托管人并报中国证监会；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行

赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

① 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金会计责任方的建议执行，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

② 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%；

③ 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付；

④ 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(4) 前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### (七) 暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值；
- 4、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不

能出售或评估基金资产的；

5、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### （八）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后将当日的净值计算结果发送给基金托管人（封闭式基金为每周五）。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定对基金净值予以公布。

基金份额净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

#### （九）特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按股票估值方法的第（3）项、债券估值方法的第（7）项或权证估值方法的第（4）项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响；

## 十三、基金收益与分配

### （一）收益的构成

本基金的收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券价差、银行存款利息以及其他收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入基金收益。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### （三）收益分配原则

- 1、基金收益分配比例按有关规定制定；
- 2、本基金每年收益分配次数最多为 4 次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 75%；
- 3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 4、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 5、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
- 6、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若基金合同生效不满 3 个月，可以不进行收益分配；
- 7、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- 8、每一基金份额享有同等分配权；
- 9、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）收益分配方案

本基金收益方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人复核后确定，基金管理人应 2 日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告，并在公开披露日报中国

证监会备案。

(六) 基金收益分配中发生的费用

现金红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，注册登记机构可将投资者的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照”业务管理规则”执行。

## 十四、基金费用与税收

### (一) 与基金运作有关的费用

#### 1、与基金运作有关费用列示

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 基金合同生效后的基金信息披露费用；
- (4) 基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金的证券交易费用；

(7) 在有关规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，销售服务费的具体计提方法、计提标准在招募说明书或有关公告中载明；

(8) 按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金资产中列支的其他费用。本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

#### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### (1) 基金管理费

本基金的管理费按基金资产净值的 1.5% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

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前 2 个工作日内从基金资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) 基金托管费

本基金的托管费按基金资产净值的 2.5‰ 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

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管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

(3) 上述“1、与基金运作有关费用列示”中(3)－(8)项费用由基金托管人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，从基金财产中支付。

### 3、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。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用，不得从基金财产中列支。其他具体不列入基金费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

### 4、费用调整

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或基金托管费率。调高基金管理费率或基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率或基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

## (二) 与基金销售有关的费用

### 1、申购费用

基金申购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”相应部分。

### 2、赎回费用

基金赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”相应部分。

## (三) 基金税收

本基金运作过程中的各类纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十五、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金合同生效少于3个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### （二）基金的年度审计

- 1、本基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案。
- 3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案。更换会计师事务所应在2日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

## 十六、基金的信息披露

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。

本基金信息披露义务人按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### （一）公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

#### 一）基金招募说明书、基金合同、基金托管协议

基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金

托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在网站上。

1、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。本基金合同生效后，基金管理人在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新后的招募说明书摘要登载在指定报刊上；基金管理人在公告的15日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。

2、基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

## 二) 基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

## 三) 基金合同生效公告

基金管理人应当在本基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

## 四) 基金资产净值、基金份额净值

本基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

## 五) 基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申

购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

六) 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

基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上。

基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上。

基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

基金定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和本基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用中国证监会规定的方式。

七) 临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和本基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开；
- 2、终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；
- 4、更换基金管理人、基金托管人；
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7、基金募集期延长；
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托

管人基金托管部门负责人发生变动；

- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14、重大关联交易事项；
- 15、基金收益分配事项；
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金份额发售机构；
- 20、基金更换注册登记机构；
- 21、本基金开始办理申购、赎回；
- 22、本基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、本基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、本基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、中国证监会规定的其他事项。

#### 八) 澄清公告

在本基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

#### 九) 基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。召开基金份额持有人大会的，召集人应当至少提前 30 日公告基金份

额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，本基金管理人、本基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

十) 中国证监会规定的其他信息。

## (二) 信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定报刊和网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定报刊和网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

## (三) 信息披露文件的存放与查阅

招募说明书公布后，应当分别置备于基金管理人、基金托管人和基金份额发售机构的住所，供公众查阅、复制。

基金定期报告公布后，应当分别置备于基金管理人和基金托管人的住所，供公众查阅、复制。基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 十七、风险揭示

本基金是一只主动投资的股票型基金，属于风险适度偏高的证券投资基金品种。本基金力争在严格控制风险的前提下谋求实现基金资产长期稳定增长，实现较高的超额收益。

### （一）投资于本基金的主要风险

#### 1、市场风险

证券市场价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

##### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

##### （2）经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

##### （3）利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

##### （4）上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

##### （5）购买力风险

如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

#### 2、信用风险

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失。

#### 3、债券收益率曲线变动风险。债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线

非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

4、再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得较少的收益率

#### 5、流动性风险

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。

在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

#### 6、管理风险

在基金管理运作过程中，可能因基金管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响基金的收益水平。基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对基金收益水平存在影响。

#### 7、操作或技术风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在开放式基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

#### 8、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

#### 9、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失。

金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出基金管理人自身

直接控制能力之外的风险，可能导致基金或者基金份额持有人利益受损。

(二) 声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过中国农业银行、国海证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司等代销机构代理销售，但是，基金并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

## 十八、基金合同的变更、终止和基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

1、下列涉及到基金合同内容变更的事项须召开基金份额持有人大会：

- （1）更换基金管理人；
- （2）更换基金托管人；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- （5）变更基金类别；
- （6）变更基金投资目标、范围或策略；
- （7）变更基金份额持有人大会程序；
- （8）对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项；
- （9）法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他事项。

2、除非法律法规和基金合同另有规定，对基金合同的变更应当召开基金份额持有人大会的，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议通过，并报中国证监会核准或备案。

3、依现行有效的有关法律法规，对基金合同的变更自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

4、除依本基金合同和依现行有效的有关法律法规，对基金合同的变更须基金份额持有人大会决议通过和须报中国证监会核准以外的情形，经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同进行变更后公布，并报中国证监会备案。

### （二）基金合同的终止

1、有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- （1）基金份额持有人大会决定终止的；
- （2）基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- （3）基金合同约定的其他情形；
- （4）中国证监会规定的其他情况。

2、基金合同终止时，基金管理人应予公告并组织清算小组对基金财产进行

清算。

### （三）基金财产的清算

#### 1、基金财产清算组

（1）基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

#### 2、基金财产清算程序

（1）由基金财产清算小组统一接管基金；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）对基金财产进行分配；

（5）制作清算报告；

（6）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（7）将清算报告报中国证监会备案并公告。

#### 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

#### 4、基金财产清算剩余资产的分配

基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 5、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所

审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。

6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 十九、基金合同的内容摘要

(一) 基金份额持有人、基金管理人、基金托管人的权利、义务

一) 基金份额持有人的权利、义务

基金份额持有人购买本基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受, 基金份额持有人自取得依据基金合同募集的基金份额, 即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人, 直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为本基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金份额持有人的权利包括但不限于:

- (1) 按基金合同的规定取得基金收益;
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产;
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会;
- (5) 按基金合同的规定出席或者委派代表出席基金份额持有人大会, 对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
- (7) 监督基金管理人的投资运作;
- (8) 对基金管理人、基金托管人、销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;
- (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、每份基金份额具有同等的合法权益。

3、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金份额持有人的义务包括但不限于:

- (1) 遵守基金合同及相关业务规则;
- (2) 缴纳基金认购、申购、赎回等涉及的款项及法律法规和基金合同规定的费用;
- (3) 在持有的基金份额范围内, 承担基金亏损或者合同终止的有限责任;
- (4) 不从事任何有损基金及基金合同当事人合法权益的活动;

(5) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；

(6) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

## 二) 基金管理人的权利、义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

(1) 自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；

(2) 依照基金合同收取基金认购费和申购费、基金赎回费、基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

(3) 销售基金份额；

(4) 担任或委托其他符合条件的机构担任注册登记机构办理基金注册登记业务并收取基金合同规定的费用；

(5) 依据基金合同及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了基金合同及国家有关法律规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金份额持有人的利益；

(6) 召集基金份额持有人大会；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、委托、更换基金代销机构，对基金代销机构的相关行为进行监督和处理。如认为基金代销机构违反本基金合同、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金份额持有人的利益；

(9) 依据本基金合同及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；

(10) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(11) 在符合有关法律规法规和基金合同的前提下，制订和调整开放式基金业务管理规规则，决定和调整除调高托管费率和费率率之外的基金相关费率结构和收费方式；

(12) 依照法律规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利

益行使基金所投资的证券项下的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

(14) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(15) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集基金，办理基金备案手续；

(2) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

(3) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(4) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购与赎回业务或委托符合条件的其他机构代理该项业务；

(5) 配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托符合条件的其他机构代理该项业务；

(6) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(7) 除依据法律法规和基金合同及其他有关规定外，不得以基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(8) 依法接受基金托管人的监督；

(9) 采取适当合理的措施使基金份额认购、申购、赎回的计算方法符合基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(10) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告，编制季度、半年度和年

度基金报告；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除法律法规和基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

(13) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(16) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(17) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(18) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证基金投资者能够按照本基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(19) 参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(20) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(21) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(22) 基金托管人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金募集期限届满未能达到基金合同的备案条件，基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计在募集期产生的利息在募集期结束后 30 天内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(26) 法律、法规和基金合同规定的其他义务。

### 三) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自本基金合同生效之日起，依法律法规和本基金合同的规定安全保管基金财产；

(2) 依基金合同约定获得基金托管费、以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反本基金合同及国家法律法规行为，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金份额持有人的利益；

(4) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；

(5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；

(6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户负责基金的债券及资金的清算；

(7) 提议召开基金份额持有人大会；

(8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的资产托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有资产以及不同的基金财产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据法律法规和基金合同的规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除法律法规和基金合同另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 按有关规定，保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益合赎回款项；

(15) 按照规定召集基金份额持有人大会，或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

(16) 参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(17) 面临解散、依法被撤销或破产时，及时报告中国证监会和银行业监管机构，并通知基金管理人；

(18) 因违反合同导致基金财产的损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(19) 基金管理人因违反合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人的

利益向基金管理人追偿；

(20) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(21) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。

一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1) 终止《基金合同》；

(2) 更换基金管理人；

(3) 更换基金托管人；

(4) 转换基金运作方式；

(5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

(6) 变更基金类别；

(7) 变更基金投资目标、范围或策略；

(8) 变更基金份额持有人大会程序；

(9) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项；

(10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费；

(2) 在基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(5) 除按照法律法规和基金合同规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

5、如在上述第 4 条情况下，基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 天，在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点、方式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权利登记日；
- （4）代理投票授权委托书送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交的截止时间和收取方式。

#### 四）基金份额持有人出席会议方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由会议召集人确定，但更换基金管理人和基金托管人必须以现场开会方式召开。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于在权利登记日本基金总份额的 50%（含 50%）。

2、通讯开会。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代为出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不少于在权利登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

## 五) 议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如基金合同的重大修改、决定终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、法律法规及基金合同规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

（1）关联性。对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和《基金合同》规定的基金份额持有人大会职权范围的议案，大会召集人应将提案提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

（2）程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

基金份额持有人大会不得对未实现公告的议事内容进行表决。

### 2、议事程序

#### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表均未能出

席或主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

## （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，公告会议通知时应当同时公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 七）计票

### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未能出席或主持大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开

始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## 八) 生效与公告

基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

## (三) 基金合同解除和终止的事由、程序

### 一) 基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、基金合同约定的其他情形；

4、中国证监会规定的其他情况。

## 二) 基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

## 4、基金财产清算程序：

- (1) 由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 对基金财产进行分配；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告。

## 三) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

## 四) 基金财产清算剩余资产的分配

基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

## 五) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。

## 六) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### （四）争议解决方式

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

本基金合同受中国法律管辖。

#### （五）基金合同的存放和获得方式

基金管理人在基金份额发售的 3 日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同登载在网站上。

基金合同可印制成册并对外公开散发或供基金份额持有人在有关场所查阅，但应以基金合同正本为准。

## 二十、基金托管协议的内容摘要

### （一）基金托管协议当事人

#### 一）基金管理人

名称：国海富兰克林基金管理有限公司

注册地址：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅锋

成立时间：2004 年 11 月 15 日

批准设立机关及批准设立文号：证监基金字[2004]145 号

组织形式：中外合资经营

注册资本：人民币 2.2 亿元

营业期限：50 年

#### 二）基金托管人

名称：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：北京市西三环北路 100 号金玉大厦

法定代表人：项俊波

成立时间：1979 年 2 月 23 日

批准设立机关及批准设立文号：国发（1979）056 号

组织形式：国有独资企业

注册资金：361 亿元人民币

存续期间：持续经营

### （二）基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

一）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，建立相关的技术系统，对基金托管人的投资运作进行监督。主要包括以下方面：

- 1、对基金的投资范围、投资对象进行监督；
- 2、对基金投融资比例进行监督；
- 3、对基金投资禁止行为进行监督。为对基金禁止从事的关联交易进行监督，

基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单；

4、为控制基金参与银行间债券市场的信用风险，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督，监督内容包括但不限于交易对手的资信控制和交易方式（如见券付款、见款付券）的控制；

5、基金投资银行存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督；

6、根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资其他方面进行监督。

二）基金托管人应根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

三）基金托管人在上述一）、二）项的监督与核查中发现基金管理人违反法律法规的规定及《基金合同》、本托管协议的约定，应当及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正，并予协助配合。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会，同时书面通知基金管理人限期纠正。

四）基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《基金合同》、本托管协议及其他有关规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

五）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复基金托管人并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证，对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积

极配合提供相关数据资料和制度等。

### （三）基金管理人

一）基金管理人有权对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

二）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、基金托管协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正。

三）基金托管人有义务配合和协助基金管理人依照本协议对基金业务执行监督、核查，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。

### （四）基金财产的保管

#### 一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保基金财产的完整与独立。

5、对于因基金投资、基金申（认）购过程中产生的应收财产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日基金财产没有到达托管人处的，托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

## 二）募集资金的验证

募集期内销售机构将认购资金划入基金管理人在具有托管资格的商业银行开设的国海富兰克林基金管理有限公司基金认购专户。基金募集期满，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金份额持有人的人数不少于 200 人的条件下，基金管理人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字后方为有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具基金财产接收报告。

## 三）基金的银行账户的开设和管理

基金托管人以基金的名义在其营业机构开设基金托管专户，保管基金的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的基金托管专户进行。

基金托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立除满足开展基金业务需要以外的任何银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金托管专户的管理应符合中国银行业监督管理委员会以及中国人民银行的有关规定。

## 四）基金进行定期存款投资的账户开设和管理

基金托管人根据基金管理人的指令以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，并负责该账户的日常管理以及银行预留印鉴的保管和使用。基金管理人应派专人协助办理开户事宜。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的

相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

#### 五) 基金证券交收账户和资金交收账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让本基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，基金托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定；法律法规另有规定的从其规定。

#### 六) 同业拆借市场交易账户和债券托管账户的开设和管理

1、基金合同生效后，基金管理人负责向中国证监会和中国银行业监督管理委员会申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易。由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户，由基金托管人负责以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设债券托管乙类账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。在上述手续办理完毕之后，由基金托管人负责向中国人民银行报备。

2、同业拆借市场交易账户和债券托管账户根据中国人民银行、中国外汇交易中心和中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，由基金管理人和基金托管人签订补充协议，进行使用和管理。基金管理人和基金托管人应共同负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

#### 七) 基金实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

基金财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由基金托管人存放于托管银行的保管库；也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中登上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。实物

证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。

属于基金托管人实际有效控制下的有价凭证在基金托管人保管期间的毁损、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。基金托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担责任。

#### 八) 与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管。

与基金有关的重大合同的签署，除本协议另有规定外，由基金管理人负责签署。签署时应保证基金一方持有两份以上正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。如上述合同只有一份正本先由基金管理人取得，则基金管理人应及时将正本送达基金托管人处保管。与基金有关的重大合同签署后十个工作日内，基金管理人应将合同正本发送给基金托管人。

基金托管人应妥善保管与基金有关的重大合同，保存期限不少于十五年或法律法规规定的其他期限。

### (五) 基金资产净值计算与复核

#### 一) 基金资产净值的计算和复核

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总份额后的价值。

2、基金管理人应每日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计业务指引》及其他法律法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值并以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，当日签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人公布基金份额净值。

3、如有确凿证据表明估值不能客观反映基金财产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、如果基金托管人的复核结果与基金管理人的计算结果存在差异，且双方

经协商未能达成一致，基金管理人可以按照其对基金份额净值的计算结果对外予以公布，基金托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

5、基金管理人、基金托管人发现基金估值违反《基金合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

## 二) 估值差错的处理

因基金估值错误给投资者造成损失的应先从基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

当基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金额。就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，按照差错发生的具体情况，由基金管理人与基金托管人各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失，以及由此造成以后交易日基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

针对净值差错处理，如果法律法规或证监会有新的规定，则按新的规定执行；如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，相关各方当事人应本着平等互利的原则重新协商确定处理原则。

当基金管理人计算的基金份额净值与基金托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以基金管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失以及因该交易日基金份额净值计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任，但有权向相关责任方追偿。

### 三) 基金会计核算

#### 1、基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后, 应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则, 分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册。

#### 2、会计数据和财务指标的核对

基金管理人和基金托管人应对相关各方各自的账册定期进行核对, 互相监督, 以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧, 应以基金管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的, 基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正, 保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符, 暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的, 以基金管理人的账册为准。

#### 3、基金财务报表与定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制, 应于每月终了后 5 日内完成。

在本基金合同生效后每六个月结束之日起 45 日内, 基金管理人对招募说明书更新一次。基金管理人在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成季度报告编制并公告; 在会计年度上半年终了后 60 日内完成半年度报告编制并公告; 在会计年度结束后 90 日内完成年度报告编制并公告。

基金管理人在月度报表完成当日, 对报表加盖公章后, 以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核; 基金托管人在 5 日内完成复核, 并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在季度报告完成当日, 将有关报告提供基金托管人复核, 基金托管人在收到后 10 日内完成复核, 并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日, 将有关报告提供基金托管人复核, 基金托管人在收到后 30 日内完成复核, 并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日, 将有关报告提供基金托管人复核, 基金托管人在收到后 45 日完成复核, 并将复核结果书面通知基金管理人。基金托管人在复核过程中, 发现相关各方的报表存在不符时, 基金管理人和基金托管人应共同查明原因, 进行调整, 调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后, 基金

托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，相关各方各自留存一份。

基金托管人在对财务会计报告、半年度报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

基金定期报告应当在公开披露的第二个工作日，由基金管理人分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地的中国证监会派出机构备案。

#### （六）基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册，由基金注册登记机构负责编制和保管。基金份额持有人名册记载内容包括但不限于基金份额持有人的名称及其持有的基金份额。

基金管理人应定期或不定期向基金托管人提供下列情形下的基金份额持有人名册：

- （1）基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- （2）基金权益登记日的基金份额持有人名册；
- （3）基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- （4）每月最后一个交易日的基金份额持有人名册。

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册，保存期限不少于十五年或法律法规规定的其他期限。因基金托管人未能妥善保管基金份额持有人名册而给基金管理人、基金份额持有人或其他相关主体造成损失的，基金托管人应依法承担相应责任。

#### （七）争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担或按仲裁裁决确定。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中华人民共和国法律管辖。

## （八）托管协议的修改与终止

### 一）托管协议的变更

本协议相关各方当事人经协商一致,可以对协议进行修改。修改后的新协议,其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突,并应当报中国证监会核准。

### 二）托管协议的终止

发生以下情况,本托管协议终止:

- 1、基金合同终止;
- 2、本基金更换基金托管人;
- 3、本基金更换基金管理人;
- 4、发生《基金法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 二十一、对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化增加、修改这些服务项目。主要的服务项目如下：

### （一）基金份额持有人注册登记服务

本基金管理人同时兼任本基金的注册登记机构，在公司内部设立了专门的运营部门负责基金份额持有人的注册登记业务，配备先进、高效的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金份额持有人办理基金账户业务、汇总和储存并管理基金的所有认购、申购和赎回信息，确保基金份额持有人的注册登记工作的准确和顺利进行。

### （二）资料寄送

#### 1、基金交易确认单

每次交易结束后，基金份额持有人可在 T+2 个工作日后通过销售机构的网点查询和打印交易确认单。

#### 2、基金交易对账单

在从销售机构获取准确的邮政地址和邮政编码的前提下，基金管理人将负责寄送基金交易对账单。

基金交易对账单包括季度对账单与年度对账单。季度对账单在每季度结束后的 10 个工作日内向有交易的基金份额持有人以书面或电子形式寄送，若基金投资者在季度期内无交易发生，将不邮寄该季度的对账单；年度对账单在年度结束后的 15 个工作日内对所有基金份额持有人以书面或电子形式寄送。注册登记机构根据销售机构上传的客户开户信息进行对账单寄送工作，客户可自行选择寄送或不寄对账单。

#### 3、其他相关的信息资料

其他相关的信息资料指不定期寄送的基金资讯材料，如基金新产品或新服务的相关材料、基金经理报告、客户服务问答等。

### （三）红利再投资

本基金收益分配时，基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金，

注册登记机构将其所获红利按分红实施日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。基金份额持有人可以随时选择更改基金分红方式。

#### （四）定期定额投资

本基金通过销售机构为基金份额持有人提供定期定额投资的服务，即基金份额持有人可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购基金份额。定期定额投资不受最低申购金额限制，具体实施时间和业务规则详见相关公告。

#### （五）资讯服务

##### 1、手机短信服务

基金份额持有人可以通过本公司网站和客户服务热线人工应答预留手机号码，按需要定制短信内容并选择发送频率，我们将根据定制要求提供相应服务。

##### 2、电子邮件服务

基金份额持有人可以在本基金管理人网站注册，登录定制所需要的各类公开信息。如果留下个人邮箱，将会收到定制的信息。

#### （六）客户服务中心

##### 1、客户服务电话

呼叫中心自动语音系统提供每周 7 天、每天 24 小时的自助语音服务和查询服务，客户可通过电话收听最新公告信息、基金份额净值，自助查询基金账户余额信息、交易确认情况等。同时，呼叫中心在工作时间提供人工应答服务。

##### 2、网上客户服务中心

网上客户服务中心为基金份额持有人提供查询服务、资讯服务以及相互交流的平台。注册登录后，基金份额持有人可以查询个人账户资料，包括基金持有情况、基金交易明细、基金分红实施情况等；此外，还可以修改个人账户资料，查询热点问题及其解答，查阅投资刊物，或提交投诉和建议等等。

公司网址：WWW.FTSFUND.COM

电子信箱：SERVICE@FTSFUND.COM

#### （七）客户投诉处理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供的网上投诉栏目、呼叫中心自动语音留言、呼叫中心人工坐席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉。基金份额持有人还可以通过代销机构的服务电话对

该代销机构提供的服务进行投诉。

(八) 服务渠道

- 1、咨询电话：021-3878 9555
- 2、网站：[WWW.FTSFUND.COM](http://WWW.FTSFUND.COM)
- 3、传真：021-6887 0708
- 4、其他，如邮寄等。

## 二十二、其它应披露事项

1. 2007年12月28日，国海富兰克林基金管理有限公司关于增加注册资本的公告
2. 2008年1月4日，国海富兰克林基金管理有限公司关于聘任金哲非女士担任总经理的公告
3. 2008年1月15日，国海富兰克林基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告
4. 2008年1月22日，富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金2007年第四季度报告及精要
5. 2008年1月25日，富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金更新招募说明书（2008年第1号）及摘要
6. 2008年2月27日，国海富兰克林基金管理有限公司关于变更公司章程的公告
7. 2008年3月20日，关于国富弹性基金与国富潜力基金在中国工商银行开办定期定额投资业务的公告
8. 2008年3月27日，富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金2007年年度报告及摘要
9. 2008年3月27日，富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金2007年年度报告精要
10. 2008年4月15日，关于增加华泰证券有限责任公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告
11. 2008年4月18日，关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下基金参加中国农业银行定期定额业务费率优惠活动的公告
12. 2008年4月21日，关于增加中信银行股份有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告
13. 2008年4月21日，富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金2008年第一季度报告及精要
14. 2008年4月23日，关于通过华泰证券有限责任公司网上交易系统申购国海

富兰克林旗下开放式基金实行费率优惠的公告

15. 2008年4月24日, 关于增加湘财证券有限责任公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告

16. 2008年4月30日, 关于增加国元证券股份有限公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告

17. 2008年4月30日, 关于增加江南证券有限责任公司为国海富兰克林基金管理有限公司旗下基金代销机构的公告

18. 2008年6月10日, 国海富兰克林基金管理有限公司关于寻找地震受灾地区基金份额持有人的公告

## 二十三、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构的办公场所，投资者可在办公时间查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十四、备查文件

备查文件等文本存放在基金管理人、基金托管人和销售机构的办公场所和营业场所，在办公时间内可供免费查阅。

(一)中国证监会批准富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金募集的文件

(二)《富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金基金合同》

(三)《富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金托管协议》

(四)法律意见书

(五)基金管理人业务资格批件、营业执照

(六)基金托管人业务资格批件和营业执照

(七)《国海富兰克林基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》

(八)中国证监会要求的其他文件

国海富兰克林基金管理有限公司

二〇〇八年七月二十六日