富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金更新招募说明书(摘要)

(2009 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】

富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证监会 2008 年 8 月 15 日证监基金字【2008】1049 号文核准募集,本基金的基金合同于 2008 年 10 月 24 日生效。本基金自 2008 年 12 月 18 日起新增 C 类收费模式。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

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合同当事人之间权利、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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书已经本基金托管人复核。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2009 年 10 月 24 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2009 年 9 月 30 日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:国海富兰克林基金管理有限公司
注册地址:广西南宁市琅东滨湖路 46 号
办公地址:上海浦东富城路 99 号震旦国际大楼 18 楼
法定代表人:张雅锋
成立日期:2004 年 11 月 15 日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2004]145 号
组织形式:有限责任公司
注册资本:2.2 亿元人民币
存续期限:50 年
联系人:陈明月
联系电话:021-3855 5600
股权结构:国海证券有限责任公司持有 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,Franklin Resources,Inc. 副执行总裁。现已退休。

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。现任广西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。现任浙江网新恒天软件有限公司董事长(非执行)。

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,索芙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,兼索芙特股份有限公司董事。

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

监事会成员:

2、监事会成员

监事会主席何雅玲女士,本科学历。曾在麦坚时律师事务所,隶属摩根大通资产管理的 JF 资产管理有限公司工作。现任富兰克林邓普顿投资(亚洲)有限公司首席法律顾问——亚洲区。

监事李慧女士,中共党员,硕士研究生学历。历任广西证券公司上海营业部财务部及交易部经理,广西证券有限责任公司稽核部总经理。现任国海证券有限责任公司稽核监察部总经理。

监事张志强先生,硕士研究生学历,特许金融分析师(CFA)。曾在美国 Enreach Technology Inc.、海通证券股份有限公司、友邦华泰基金管理有限公司工作。2007 年 4 月加入国海富兰克林基金管理有限公司,现任首席数量分析师、投资风险管理部总经理和业务发展部总经理。

3、经营管理层人员

总经理金哲非女士,中国科技大学计算机科学学士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。

副总经理李雄厚先生,中山大学企业管理硕士。历任中国工商银行深圳市分行业务发展部高级经理、宝安证券营业部负责人、上海证券业务部筹建负责人,鹏华基金管理有限公司市场部渠道销售主管,招商基金管理有限公司营销管理部总监,友邦华泰基金管理有限公司副总经理,景顺投资管理有限公司(INVESCO HK)机构业务联席总监。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。

5、基金经理

现任基金经理

刘怡敏女士,CFA,2003 年毕业于四川大学,获金融学硕士学位。曾任富国基金管理有限公司固定收益部债券研究员,西南证券研究发展中心策略部债券研究员。

历任基金经理

无,该基金自成立以来一直由刘怡敏女士任基金经理,没有发生基金经理变更。

6、投资决策委员会成员

本基金采取集体投资决策制度。

投资决策委员会由下述委员组成: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、基金经理);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);刘怡敏女士(本基金基金经理);赵晓东先生(基金经理);张志强先生(投资风险控制部总经理、业务发展部总经理)。吴显玲女士(督察长)有权列席投资决策委员会的任何会议。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人的基本情况
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
变更注册登记日期:2004 年 8 月 26 日
注册资本:人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元
法定代表人:肖 钢
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
托管及投资者服务部总经理:董杰
托管部门联系人:宁敏
电话:(010)66594977
传真:(010)66594942
发展概况:

中国银行业务涵盖商业银行、投资银行和保险三大领域,其中,商业银行业务是中国银行的传统主营业务,包括公司金融业务、个人金融业务及金融市场业务。中国银行提供的公司金融业务包括存款业务、贷款业务、国际结算及贸易融资业务,以及银行汇票、本票、支票、汇兑、银行承兑汇票、委托收款、托收承付、集中支付、支票圈存及票据托管等其他公司金融业务;个人金融业务包括储蓄存款业务、个人贷款业务、个人中间业务、"中银理财"服务、私人银行业务和银行卡业务等;金融市场业务主要包括本外币金融工具的自营与代客业务、本外币各类证券或指数投资业务、债务资本市场业务、代客理财和资产管理业务、金融代理及托管业务等。

中国银行在国内同业中率先引进国际管理技术人才和经营理念,不断向国际化一流大银行的目标迈进,截至 2008 年末,中国银行境内外机构共有 10,789 家,其中内地机构 9,983 家,港澳及境外机构 806 家。内地商业银行部分,一级分行、直属分行 37 家,二级分行 284 家,基层分支机构 9,659 家,是中国国际化程度最高的银行。

2009 年上半年中国银行集团实现归属于母公司所有者的净利润 410.05 亿元,股本净回报率(不含少数股东权益,ROE)为 17.39%,总资产净回报率(ROA)为 1.14%,资本充足率为 11.53%。

多年来中国银行围绕客户需求所做的不懈努力,得到了来自业界、客户和权威第三方的广泛认可。在与国际同业和国内同业的激烈竞争中,凭借雄厚的实力和优良的服务,中国银行脱颖而出,成为北京 2008 年奥运会唯一的银行合作伙伴;自 1990 年以来,中国银行一直荣登《财富》500 强排行榜;2004 至 2008 年,中国银行连续被《环球金融》杂志评为"中国最佳外汇银行",并评为 2008 年度中国最佳债券和现金管理银行;2008 年,中国银行在《银行家》杂志"世界 1000 家大银行"中排名第 10 位;2008 年中国银行被《财资》评为中国最佳贸易融资银行;2008 年中国银行被《金融亚洲》评为最佳贸易融资银行、最佳外汇交易银行、最佳派息政策承诺奖、亚洲最佳公司(最佳股利政策);2008 年中国银行被《亚洲货币》杂志和《贸易融资》杂志分别评为中国最佳外汇服务银行和中国本土最佳贸易服务银行;2008 年中国银行被《欧洲货币》评为中国区最佳商业银行、中国区债务资本市场最佳投资银行、香港区最佳商业银行和中国区最佳外汇服务奖;2008 年中国银行再次荣获"优信咨询(Universum)"评选的"最理想雇主奖"。

(二)托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权, 并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求, 以控制和防范基金托管业务风险为主线,制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度,将风险控制落实到每个工作环节;在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙,安装了录音监听系统,以保证基金信息的安全;建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度,保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全;制定了内部信息管理制度,严格遵循基金信息披露规定和要求,及时准确地披露相关信息。

托管及投资者服务部总经理对托管业务的风险控制负第一责任。部门内部设有专门的风险控制小组,作为部内风险管理与内部控制的审议和决策机构,负责审议决定托管及投资者服务部风险管理战略、基本原则、风险管理目标和重大政策措施,检查和监督风险管理战略、方针和政策的执行情况。针对托管业务的特点,托管及投资者服务部内部设立高级合规官和风险与合规管理团队,具体开展部门内部内控及风险管理的相关工作。

最近一年内,中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行为,未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

(三)托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同的相关规定,托管人就基金的投资范围、投资组合比例、投资限制、基金管理人报酬和基金托管人托管费的计提比例和支付方法、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配等事项,对基金管理人进行业务监督、复核。基金托管人在履行上述职责过程中,如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,立即通知基金管理人,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,应当立即通知基金管理人,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:广西南宁市琅东滨湖路 46 号
办公地址:上海浦东富城路 99 号震旦国际大楼 18 楼
法定代表人:张雅锋
联系人:鞠莉莉
联系电话:021-3855 5678

2、代销机构:
(1)富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金[A 类]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
法定代表人:肖钢
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
住所:北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址:北京市东城区建国门内大街 69 号
法定代表人:项俊波
客户服务电话:95599
公司网址:www.abchina.com

3)　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
客户服务电话:95588
联系人:田耕
公司网站:www.icbc.com.cn

4)　中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街 25 号
办公地址:北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼(长安兴融中心)
法定代表人:郭树清
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.com

5)　中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座
地址:北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座
法定代表人:孔丹
电话:010-6555 7013
传真:010-6555 0827
联系人:金蕾
客户服务电话:95558
公司网址:bank.ecitic.com

6)　华夏银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街 22 号
法定代表人:吴建
电话:010-85238667
传真:010-85238680
联系人:郑鹏
客户服务电话:95577
公司网站:www.hxb.com.cn

7)　招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
法定代表人: 秦晓
电话:0755-83077960
传真:0755-83195109
联系人:马强
客户服务电话:95555
网址:www.cmbchina.com

8)　中国光大银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦
法定代表人:唐双宁
联系人:李伟
电话:010-68098778
传真:010-68560661
客户服务电话:95595
网址:www.cebbank.com

9)　中国民生银行股份有限公司
注册地址:北市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址:北市西城区复兴门内大街 2 号
法定代表人:董文标
联系电话:010-58351666
传真::010-83914283
联系人:吴海鹏、董云巍
客户服务电话:95568
公司网址:www.cmbc.com.cn

10)　交通银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路 188 号
法定代表人:胡怀邦
电话:021-58781234
传真:021-58408483
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

11)　宁波银行股份有限公司
住所: 宁波市江东区中山东路 294 号
法定代表人:陆华裕
电话:021-63586210
传真:021-63586215
联系人: 胡技勋
客户服务电话:96528(上海地区 962528)
网址:www.nbcb.com.cn

12)　上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路 500 号
办公地址:上海市中山东一路 12 号
法定代表人:吉晓辉
电话:021-61618888
传真:021-63604199
联系人:徐伟、虞谷云
客户服务电话:95528
公司网站:www.spdb.com.cn

13)　东莞银行股份有限公司
注册地址:东莞市运河东一路 193 号
法定代表人:廖玉林
电话:0769-22119061
传真:0769-22117730
联系人:胡昱
客户服务电话:0769-96228、0769-22118118
网址:www.dongguanbank.cn

14) 国海证券有限责任公司
注册地址:广西南宁市滨湖路 46 号国海大厦
法定代表人:张雅锋
电话:0755 - 83707413
传真:0755 - 83700205
联系人:武斌
客户服务电话:400-888-8100(全国)、96100(广西)
公司网站:www.ghzq.com.cn

15) 中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址:北京朝内大街 188 号
法定代表人:张佑君
客户服务电话:400-8888-108
开放式基金业务传真:010-65182261
联系人:权唐
公司网站:www.csc108.com

16) 国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路 618 号
办公地址:上海市浦东新区银城中路 168 号
法定代表人:祝幼一
客户服务电话:400-8888-666
公司网址:www.gtja.com

17) 海通证券股份有限公司
注册地址: 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
客户服务电话: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

18) 中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
法定代表人:胡关金
客户服务电话:400-8888-888
电话:010-66568047
联系人:李洋
公司网址:www.chinastock.com.cn

19) 兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路 99 号标力大厦
办公地址:上海浦东新区民生路 1199 弄证大·五道口广场 1 号楼 21 层
法定代表人:兰荣
客户服务电话:400-8888-123
联系人:谢高得
业务联系电话:021-38565775
业务联系人:杨盛芳
公司网址:www.xyzq.com.cn

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

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

22) 华泰联合证券有限责任公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层
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、95513
联系人:盛宗凌
网址:www.lhzq.com

23) 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
法定代表人:李玮
客户服务电话:95538
联系人:傅咏梅
网址: www.qlzq.com.cn

24) 广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼
办公地址:广东广州天河北路大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼
法定代表人:王志伟
电话:020-87555888-875
客户服务电话:961133
开放式基金业务传真:020-87555305
联系人:肖中梅
网址:www.gf.com.cn

25) 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:0431-85096709
客户服务电话: 400-600-0686、0431-85096733
网址:www.nesc.cn

26) 山西证券股份有限公司
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:侯巍
电话:0351-8686703
传真:0351-8686619
客户服务电话:400-666-1618
联系人:张治国
网址:www.i618.com.cn

27) 财富证券有限责任公司
地址:长沙市芙蓉中路二段 8 0 号顺天国际财富中心 2 6 层
法定代表人:周晖
电话:0731-4403319
传真:0731-4403439
联系人:郭磊
客户服务电话:0731-4403319
网址:www.cfzq.com

28) 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
传真:010-66045500
客户服务电话:010-66045678
联系人: 莫晓丽
联系人电话:010-66045529
公司网站: www.txsec.com、www.txjijin.com

29) 南京证券有限责任公司
注册地址:江苏省南京市大钟亭 8 号
法人代表:张华东
联系电话:025-83364032
联系人:徐翔
传真:025-83320066
客户服务电话:400-828-5888
公司网站:www.njzq.com.cn

30) 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:俞会亮
联系电话:0571-85776115
传真:0571-85783771
客户服务电话:0571-96598
网址:www.96598.com.cn、www.bigsun.com.cn

31) 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
客户服务电话:95597
公司网站: www.htsc.com.cn

32) 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:林俊波
电话:021-68634518
传真:021-68865680
联系人:李梦诗
联系人电话:021-68634518-8631
客户服务电话:400-888-1551
公司网站:www.xcsc.com、www.eestart.com

33) 安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元
法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82825555
传真:0755-82825560
基金业务联系人:陈剑虹
联系电话:021-82555305
客户服务电话:400-8001-001
公司网站:www.essence.com.cn

34) 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
传真:0791-6789414
联系人: 余雅娜
客户服务电话:0791-6768763
公司网站:www.scstock.com

35) 国元证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市寿春路 179 号
通讯地址:安徽省合肥市寿春路 179 号
法定代表人:凤良志
电话:0551-2207957
传真:0551-2207965
联系人:王邦金
客户服务电话:400-8888-777 或 95578、安徽省内客服电话:96888
公司网站:www.gyzq.com.cn

36) 上海证券有限责任公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路 336 号
通讯地址:上海市黄浦区西藏中路 336 号
法定代表人:蒋元真
联系人:谢秀峰
联系电话:021-53519888
客户服务电话:021-962518
公司网站:www.962518.com

37) 光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路 1508 号
通讯地址:上海市静安区新闸路 1508 号
法定代表人:徐浩明
电话:021-22169081
传真:021-22169134
联系人:刘晨
客户服务电话:400-8888-788
公司网站:www.ebscn.com

38) 江海证券有限公司
注册地址:哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
通讯地址:哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
法定代表人:孙名扬
电话:0451-82336863
传真:0451-82287211
联系人:徐世旺
客户服务电话:400-6662-288
公司网站:www.jhzq.com.cn

39) 东海证券有限责任公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路 59 号投资广场 18 楼
办公地址:江苏省常州市延陵西路 59 号投资广场 18 楼
法定代表人:朱科敏
联系人:李涛
电话:0519-88157761
传真:0519-88157761
客户服务电话:400-888-8588
公司网络地址:www.longone.com.cn

40) 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路 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:0755-82133302
联系人:齐晓燕
客户服务电话: 95536
公司网址:www.guosen.com.cn

41) 宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号
法定代表人:汤世生
电话:010-88085338
传真:010-88085240
联系人:李巍
客户服务电话:4008-000-562(全国)
公司网站:www.hysec.com

42) 华宝证券经纪有限责任公司
注册地址:中国上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 层
法定代表人:陈林
电话:021-50122222
传真:021-50122200
联系人:严俊权
客户咨询电话:400-820-9898
公司网站:www.cnhbstock.com

43) 广发华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路新天地大厦 7、8 层
法定代表人:黄金琳
电话:0591-87383623
传真:0591-87383610
联系人:张腾
客户服务电话: 96326(福建省外加拨 0591)
公司网址:www.gfhfzq.com.cn

(2)富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金[C 类]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
法定代表人:肖钢
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
住所:北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址:北京市东城区建国门内大街 69 号
法定代表人:项俊波
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(长安兴融中心)
法定代表人:郭树清
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.com

4)　交通银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路 188 号
法定代表人:胡怀邦
电话:021-58781234
传真:021-58408483
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

5)　中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座
地址:北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座
法定代表人:孔丹
电话:010-6555 7013
传真:010-6555 0827
联系人:金蕾
客户服务电话:95558
公司网址:bank.ecitic.com

6)　华夏银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街 22 号
法定代表人:吴建
电话:010-85238667
传真:010-85238680
联系人:郑鹏
客户服务电话:95577
公司网站:www.hxb.com.cn

7)　中国民生银行股份有限公司
注册地址:北市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址:北市西城区复兴门内大街 2 号
法定代表人:董文标
联系电话:010-58351666
传真::010-83914283
联系人:吴海鹏、董云巍
客户服务电话:95568
公司网址:www.cmbc.com.cn

8)　中国光大银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦
法定代表人:唐双宁
联系人:李伟
电话:010-68098778
传真:010-68560661
客户服务电话:95595
网址:www.cebbank.com

9)　上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路 500 号
办公地址:上海市中山东一路 12 号
法定代表人:吉晓辉
电话:021-61618888
传真:021-63604199
联系人:徐伟、虞谷云
客户服务电话:95528
公司网站:www.spdb.com.cn

10) 宁波银行股份有限公司
住所: 宁波市江东区中山东路 294 号
法定代表人:陆华裕
电话:021-63586210
传真:021-63586215
联系人: 胡技勋
客户服务电话:96528(上海地区 962528)
网址:www.nbcb.com.cn

11) 东莞银行股份有限公司
注册地址:东莞市运河东一路 193 号
法定代表人:廖玉林
电话:0769-22119061
传真:0769-22117730
联系人:胡昱
客户服务电话:0769-96228、0769-22118118
网址:www.dongguanbank.cn

12) 国海证券有限责任公司
注册地址:广西南宁市滨湖路 46 号国海大厦
法定代表人:张雅锋
电话:0755 - 83707413
传真:0755 - 83700205
联系人:武斌
客户服务电话:400-888-8100(全国)、96100(广西)
公司网站:www.ghzq.com.cn

13) 中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址:北京朝内大街 188 号
法定代表人:张佑君
客户服务电话:400-8888-108
开放式基金业务传真:010-65182261
联系人:权唐
公司网站:www.csc108.com

14) 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
客户服务电话:400-8888-666
公司网址:www.gtja.com

15) 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
客户服务电话: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

16) 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:胡关金
客户服务电话:400-8888-888
电话:010-66568047
联系人:李洋
公司网址:www.chinastock.com.cn

17) 兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路 99 号标力大厦
办公地址:上海浦东新区民生路 1199 弄证大·五道口广场 1 号楼 21 层
法定代表人:兰荣
客户服务电话:400-8888-123
联系人:谢高得
业务联系电话:021-38565775
业务联系人:杨盛芳
公司网址:www.xyzq.com.cn

18) 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
客户服务电话:95565、400-8888-111
公司网站:www.newone.com.cn

19) 华泰联合证券有限责任公司
注册地址:深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层
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、0755-95513
联系人:盛宗凌
网址:www.lhzq.com

20) 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
法定代表人:李玮
客户服务电话:95538
联系人:傅咏梅
网址: www.qlzq.com.cn

21) 广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼
办公地址:广东广州天河北路大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼
法定代表人:王志伟
电话:020-87555888-875
客户服务电话:95575
开放式基金业务传真:020-87555305
联系人:肖中梅
网址:www.gf.com.cn

22) 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:0431-85096709
客户服务电话: 400-600-0686、0431-85096733
网址:www.nesc.cn

23) 山西证券股份有限公司
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:侯巍
电话:0351-8686703
传真:0351-8686619
客户服务电话:400-666-1618
联系人:张治国
网址:www.i618.com.cn

24) 财富证券有限责任公司
地址:长沙市芙蓉中路二段 8 0 号顺天国际财富中心 2 6 层
法定代表人:周晖
电话:0731-4403319
传真:0731-4403439
联系人:郭磊
客户服务电话:0731-4403319
网址:www.cfzq.com

25) 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
传真:010-66045500
客户服务电话:010-66045678
联系人: 莫晓丽
联系人电话:010-66045529
公司网站: www.txsec.com、www.txjijin.com

26) 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:俞会亮
联系电话:0571-85776115
传真:0571-85783771
客户服务电话:0571-96598
网址:www.96598.com.cn、www.bigsun.com.cn

27) 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
客户服务电话:95597
公司网站: www.htsc.com.cn

28) 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:林俊波
电话:021-68634518
传真:021-68865680
联系人:李梦诗
联系人电话:021-68634518-8631
客户服务电话:400-888-1551
公司网站:www.xcsc.com、www.eestart.com

29) 安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元
法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82825555
传真:0755-82825560
基金业务联系人:陈剑虹
联系电话:021-82555305
客户服务电话:400-8001-001
公司网站:www.essence.com.cn

30) 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:0551-2207957
传真:0551-2207965
联系人:王邦金
客户服务电话:400-8888-777 或 95578、安徽省内客服电话:96888
公司网站:www.gyzq.com.cn

31) 上海证券有限责任公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路 336 号
通讯地址:上海市黄浦区西藏中路 336 号
法定代表人:蒋元真
联系人:谢秀峰
联系电话:021-53519888
客户服务电话:021-962518
公司网站:www.962518.com

32) 光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路 1508 号
通讯地址:上海市静安区新闸路 1508 号
法定代表人:徐浩明
电话:021-22169081
传真:021-22169134
联系人:刘晨
客户服务电话:400-8888-788
公司网站:www.ebscn.com

33) 江海证券有限公司
注册地址:哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
通讯地址:哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
法定代表人:孙名扬
电话:0451-82336863
传真:0451-82287211
联系人:徐世旺
客户服务电话:400-6662-288
公司网站:www.jhzq.com.cn

34) 东海证券有限责任公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路 59 号投资广场 18 楼
办公地址:江苏省常州市延陵西路 59 号投资广场 18 楼
法定代表人:朱科敏
联系人:李涛
电话:0519-88157761
传真:0519-88157761
客户服务电话:400-888-8588
公司网络地址:www.longone.com.cn

35) 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:0755-82133302
联系人:齐晓燕
客户服务电话: 95536
公司网址:www.guosen.com.cn

36) 宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号
法定代表人:汤世生
电话:010-88085338
传真:010-88085240
联系人:李巍
客户服务电话:4008-000-562(全国)
公司网站:www.hysec.com

37) 华宝证券经纪有限责任公司
注册地址:中国上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 层
法定代表人:陈林
电话:021-50122222
传真:021-50122200
联系人:严俊权
客户咨询电话:400-820-9898
公司网站:www.cnhbstock.com

38) 广发华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路新天地大厦 7、8 层
法定代表人:黄金琳
电话:0591-87383623
传真:0591-87383610
联系人:张腾
客户服务电话: 96326(福建省外加拨 0591)
公司网址:www.gfhfzq.com.cn

(二)注册登记机构
国海富兰克林基金管理有限公司
注册地址:广西南宁市琅东滨湖路 46 号
法定代表人:张雅锋
电话:(021)3855 5601
传真:(021)68880981
联系人:董卫军

(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海源泰律师事务所
住所:上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室
办公地址:上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室
负责人:廖海
联系电话:(021)51150298
传真:(021)51150398
联系人:廖海
经办律师:廖海、黎明

(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区东昌路 568 号
办公地址:上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
法定代表人:杨绍信
电话:021-6123 8888
传真:021-6123 8800
经办注册会计师:薛竞 单峰

四、基金名称

富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金

五、基金的类型

债券型开放式证券投资基金

六、基金的投资目标

通过主动的资产管理,在严格控制风险、保证资产充分流动性的基础上,力求为投资者创造持续稳定的投资回报。

七、基金的投资范围

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、股票、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金主要投资于国债、金融债、央行票据、信用等级为投资级以上的企业债、公司债和短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益证券品种。本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金也可投资于非固定收益类金融工具。本基金可以参与一级市场新股申购,也可以直接投资于二级市场的股票。本基金不直接通过二级市场买入权证,可持有股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非债券类品种。本基金投资于固定收益类资产以外的其它资产(包括股票、权证等)的比例不超过基金资产的 20%。

根据未来法律法规或监管机构相关政策的变动,本基金管理人在履行适当程序后,可以相应调整上述投资比例并投资于法律法规或监管机构允许投资的其他金融产品。

八、基金的投资策略

(一)固定收益类品种投资策略

债券投资组合的回报主要来自于组合的久期管理,识别收益率曲线中价值低估的部分以及各类债券中价值低估的种类。本基金将采取积极主动的投资策略,以中长期利率趋势分析为主,结合经济周期、宏观经济运行中的价格指数、资金供求分析、货币政策、财政政策研判及收益率曲线分析,在保证流动性和风险可控的前提下,实施积极的债券投资组合管理。

(1) 利率预期策略

利率变化是影响债券价格的最重要的因素,利率预期策略是本基金的基本投资策略。通过对宏观经济、金融政策、市场供需、市场结构变化等因素的分析,采用定性分析与定量分析相结合的方法,形成对未来利率走势的判断,并依此调整组合久期和资产配置比例。

(2) 久期控制策略

在对利率变化方向和趋势判断的基础上,确定恰当的久期目标,合理控制利率风险。在预期利率整体上升时,降低组合久期;在预期利率整体下降时,提高组合久期。

(3) 期限结构配置

在决定本基金债券组合的久期后,本基金主要采用收益率曲线分析策略决定组合期限结构配置。

收益率曲线分析策略是根据收益曲线的非平行移动调整资产组合,即通过考察市场收益率曲线的动态变化及预期变化,寻求在一段时间内获得因收益率曲线形状变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益的策略。主要有三种配置方式可以选择:子弹策略是将组合各债券到期期限高度集中于收益率曲线上的某一点;哑铃策略是将到期期限集中于曲线的两端;而梯形策略则是各期限到期的债券所占的比重基本一致。

(4) 类属资产配置策略

不同类型的债券在收益率、流动性和信用风险上存在差异,有必要将债券资产配置于不同类型的债券品种以及在不同市场上进行配置,以寻求收益性、流动性和信用风险补偿间的最佳平衡点。

在综合信用分析、流动性分析、税收及市场结构等因素分析的基础上,本基金根据对金融债、企业债等债券品种与同期限国债之间收益率利差的扩大和收窄的预期, 主动地增加预期利差将收窄的债券类属品种的投资比例,降低预期利差将扩大的债券类属品种的投资比例,获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

(5) 债券品种选择策略

在以上债券资产久期、期限和类属配置的基础上,本基金根据债券市场收益率数据,运用利率模型对单个债券进行估值分析,并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋、提前偿还和赎回等因素,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。为控制基金债券投资的信用风险,本基金投资的企业债券需经国内评估机构进行信用评估,要求其信用评级为投资级以上。如果债券获得主管机构的豁免评级,本基金根据对债券发行人的内部信用风险分析,决定是否将该债券纳入基金的投资范围。

(6) 套利策略

在有效资产配置的基础之上,基金管理人还将采用多种投资手段,把握市场上的无风险套利机会,并利用杠杆原理以及各种衍生工具,增加盈利性,控制风险。

(二)动态收益增强策略

在以上债券投资策略的基础上,本基金还将根据债券市场的动态变化,采取多种灵活的策略,获取超额收益。主要包括骑乘收益率曲线策略、息差策略等。

(1) 骑乘收益率曲线策略

骑乘收益率曲线策略是指当收益率曲线相对陡峭时,买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平处于相对高位的债券,随着债券期限剩余期限缩短,债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,通过债券收益率的下滑,获得资本利得收益。

(2) 息差策略

息差策略是指通过不断正回购融资并持续买入债券的操作,只要回购资金成本低于债券收益率,就可以达到杠杆放大的套利目标。

本基金将根据对市场回购利率走势的判断,适当地选择杠杆比率,谨慎地实施息差策略,提高投资组合的收益水平。

(三)股票投资策略

本基金的股票投资包括股票二级市场投资和新股申购。

本基金可适当参与股票二级市场的投资,主要采用"自下而上"的投资策略,将定量的股票筛选和定性的公司深度研究相结合,精选具有稳定的现金分红能力和持续的盈利增长预期,且估值合理的优质上市公司股票。

本基金认为参与新股申购获得收益不但要求对股票上市价格进行准确判断,更重要的是对上市企业更长期投资价值的判断。因此,对上市公司进行深度的基本面研究、挖掘内在投资价值是本基金获得超额收益的主要来源之一。本基金对获配新股适时选择获配新股变现时机,以获取较好的股票变现收益。

(四)可转债投资策略

可转换债券(含可交易分离可转债)兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。可转债的选择结合其债性和股性特征,在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析,投资具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券,获取稳健的投资回报。

(五)权证投资策略

本基金不直接从二级市场买入权证,可持有股票派发或可分离交易可债券所分离的权证。

九、基金的投资决策流程

严格的投资决策流程是本基金进行投资组合和控制投资风险的制度保障。本基金通过对不同层次的决策主体明确授权范围,建立完善的投资决策运作体系。投资决策委员会是本基金管理人最高的投资决策机构。

债券投资决策主要根据对宏观经济趋势的研究结论,指导对利率趋势和债券市场的判断,并据此形成投资决策。

1、宏观经济、利率期限结构和债券市场分析

宏观经济研究员对国内、国际经济趋势进行分析,债券研究员在此基础上对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测,并将分析和预测结果提交每月债券资产配置会议及其他会议讨论。

2、债券投资策略和期限配置建议

债券基金经理、宏观研究员和债券研究员经过每月债券资产配置会议对宏观经济、债券市场和利率期限结构的分析讨论,债券基金经理根据分析的结论对下阶段债券投资策略和期限配置提出建议和制定实施计划,向债券投资决策委员会提交《债券资产配置报告》。

3、债券投资策略和期限配置决策

投资决策委员会在听取宏观经济研究员、债券研究员的分析和预测结果后,对债券基金经理提交的《债券资产配置报告》进行审议,审议结果作为投资组合的债券投资策略和期限配置(范围)决策。

4、债券选择和债券组合构建

债券基金经理依照投资决策委员会审议通过的债券投资策略、债券组合久期和期限配置决策构建债券投资组合。

基金经理根据投资组合方案制定具体的操作计划,并以投资指令的形式下达至集中交易室。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。

5、投资指令的下达与执行及反馈

集中交易室依据具体执行债券等品种的买卖操作,并将指令的执行情况反馈给基金经理并提供建议,以便基金经理及时调整交易策略。

6、监察稽核部对债券投资运作过程中的合规性风险控制进行监督和检查,就发现的问题及时提醒债券基金经理及有关领导。

7、投资风险管理和业绩评估会议:由公司总经理、投资总监、研究主管和风险管理经理组成投资风险管理与业绩评估小组。该小组定期或不定期召开投资风险管理和业绩评估会议,风险管理经理提交最新的投资风险和业绩评估报告,确保所有的风险控制指标和规则均有效执行,并就潜在的风险因素进行分析和讨论,对基金的投资提出建议。风险管理经理应将投资风险和业绩评估报告,以及投资风险管理和业绩评估会议对于基金投资的建议提交投资决策委员会。

8、债券基金经理根据风险管理和业绩评估报告,以及投资风险管理与业绩评估小组的建议,结合最新信息和研究结果做出投资组合的适当调整。

十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中债总指数(全价)

中债总指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,能够反映债券市场总体走势,具有较强的代表性、权威性,并得到投资者的广泛认同,适合作为本基金的业绩比较基准。

如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。

十一、基金的风险收益特征

本基金属债券型证券投资基金,为证券投资基金中的较低风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益低于混合型基金,高于货币市场基金。

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规定,于 2009 年 10 月 23 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 2009 年 9 月 30 日,本报告财务资料未经审计。

1.　报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	15,216,401.30	7.51
	其中:股票	15,216,401.30	7.51
2	固定收益投资	160,061,559.90	78.98
	其中:债券	160,061,559.90	78.98
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	24,217,853.69	11.95
6	其他资产	3,167,138.65	1.56
7	合计	202,662,953.54	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	185,806.30	0.09
C	制造业	13,556,695.00	6.72
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	9,900.00	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,872,200.00	0.93
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,957,350.00	1.96
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	693,000.00	0.34
C7	机械、设备、仪表	3,678,645.00	1.82
C8	医药、生物制品	3,345,600.00	1.66
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	29,000.00	0.01
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	1,431,000.00	0.71
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	13,900.00	0.01
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	15,216,401.30	7.54

(下转 31 版)