

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(摘要)

【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 国富弹性市值股票"或 本基金"经中国证监会 2006年3月30日证监基金字 2006 157号文核准募集本基金的基金合同于2006年6月14日生效。 基金管理人保证本档募说明书的内容真实 推确,完整。本档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做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金 别有风险

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

基金管理人依照恪尽职守、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

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。本基金投资于证券市场基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动投资者根据所持有份额享受基金的收益,但同时也要承担相应的投资风险,基金投资中的风险包括因整体政治,经济、社会等环境因素可定券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理及建立产生的基金管理风险,某一基金的特定风险等。富兰克林国海弹性市值股票型基金为股票型基金,属证券投资基金中的转动风险收益品种。投资有风险,投资者在进行投资决策前,首行细阅读本基金的《程家设明书》及"基金合同》。本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人复核。本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人复核。本招募说明书中基金投资组合报告和基金业绩中的数据已经本基金托管人复核。

(國外教班孫先至申订)。
- 基金管理人 (一)基金管理人概况 (一)基金管理人概况 名称·国海富兰克林基金管理有限公司 住所广西南宁市西夕塘区总部路1号中国-东盟科技企业孵化基地一期C-6栋二层 设立日期2004年11月15日 北安任李县、J. 民居公

法定代表人吴显吟 办公地址上海浦东世纪大道8号上海国金中心二期9层 注册资本人民币2.2亿元 股权结构国海证券股份有限公司(原名 国海证券有限责任公司")持有51%股权,邓普顿国际股份有限 公司持有49%股权 班名人比价。

联系人:沈增 联系电话:021-3855 5555

(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

本,独立董事洪荣光先生、MBA商学硕士。历任合湾亚洲证券股份有限公司董事长及第一大股东(后与元大京华证券股份有限公司合并),H&Q(Hanbrecht & Quist Group)次茂风险投资公司董事越南国家投资基金公司董事邓普顿新兴市场信托股份有限公司董事邓普顿新火中国投资信托基金(卢森堡)董事,启股指数基金公司(英国)董事非律实信安银行董事。富兰克林邓普顿国际基金董事,益民基金管理有限公司业立董事。现任兴业置业集团中国董事长、亚洲环球证券公司(香港)董事、菲律宾信安银行独立董事国海富兰克林基金管理有限公司独立董事。 独立董事徐同女士复旦大学经济学硕士曾任上海普陀区政协委员。历任深圳特区证券公司交易部经理,办公室主任、深圳上证总经理、国泰证券公司总经理助理、北京证券公司副总经理、北京华远集团总经济师、国都证券公司总经济师、现任三亚财经论坛发展有限公司董事、国海富兰克林基金管理有限公司独立董事。

事。 总经理董事毕国强(BI CUOQIANG)先生,特许金融分析师(CFA),加拿大约克大学舒力克(Schulich)商学 院工商管理硕士(MBA),大连理工大学船舶工程工学学士。历任中国船舶工业总公司广州文冲船厂项目经 理,科长,美国景顺集团(Inveso Lid.)加拿大环盛投资管理有限公司(Inveso Timark Investments)分析师中 国证券监管理委员会基金监管部副间册符员、调研员,编序华基金管理有限公司总经理,现任 国海富兰克林基金管理有限公司总经理、董事,同时兼任国海富兰克林资产管理(上海)有限公司董事长。

数增强基金基金经理,职工监事。 职工监事戴刚先生,工商管理硕士、专业会计硕士,FRM、CFA。历任重庆工程建设总公司预算管理部助 理工程师•韩国三星集团上海代表处建设项目投资经理湘财证券有限责任公司资产管理部高级经理.浦银 安盛基金管理有限公司筹备组成员、风险管理部总监、职工监事。现任国海富兰克林基金管理有限公司风控与信息技术总监兼风险控制部总经理、职工监事。

林基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。 督察长人员: 督察长储丽莉女士、中共党员、英国伦敦大学亚非学院法律硕士。历任上海物资贸易中心股份有限公司 法律项问、投资经营部配总经理。李宁体育(上海)有限公司法律项问。2005 年加入国海富兰克林基金管理 限公司先后担任公司法律项问、高级法律项问、高级法理 时兼任公司董事会秘书、现任国海富兰克林基金管理有限公司督察长兼董事会秘书、高级法律项问。同时兼 任国海富兰克林资产管理(上海)有限公司董事会秘书。 2.本基金基金经理 现任基金经理 现任基金经理 现任苏宏全规 理研究生项目(现改为中欧国际管理学院、助教中方院长助理、无锡证美电器集团销售项目经理、美国组贸长 平洋投资管理公司高级投资管理,P还国际管理公司董事、中信资本市场宏股公司董事(中信委成员)。国 海富兰克林基金管理有限公司基金经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司副总经理、公募投资决策委 员会主席,首席基金经理。管理国富弹性市值股票基金和国富深化价值股票基金。 历任基金经理

历任基金经理 无该基金目成立以来一直由张晓东先生任基金经理。没有发生基金经理变更。 期后事项说明自2014年12月19日起。张晓东先生不再担任本基金的基金经理。由赵晓东先生接替其管 理本基金(详情请参见2014年12月20日刊登的 僖兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金基金经理变更

公告》。
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:
投资决策委员会由下述委员组成:
程资决策委员会由下述委员组成:
建商决策委员会主席、首席基金经理,徐嘉蓉先生(公司副总经理,按宽总监 研究分析部总经理、基金经理);刁晖宇先生(固定收益投资总监、QDII投资总监、基金经理);张志强先生(量化与指数投资总监、金融工程部总经理、基金经理,取工监事);戴刚先生(风控与信息技术总监兼风险控制部总经理、职工监事); 政路东先生(公社投资总监、基金经理。职工监事);

起晓东先生(权益投资总监、基金经理)。 储丽莉女士(督赛长)有权列席投资决策委员会的任何会议。 朝丽莉波明自2014年12月22日起从晓东先生不再担任本基金管理公司投资决策委员会成员。 4、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人 (一)基金托管人情况 1,基本情况

1、基本简化 名称:中国农业银行股份有限公司(简称中国农业银行) 住所:北京市东城区建国门内大街69号 办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座9层

法定代表人:蒋超良 成立日期:2009年1月15日

注册资本:32,479,411.7万元人民币 存续期间:持续经营

联系电话:010-68121510 传真:010-68121816

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业

盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品、致力力,大客户提供优质的金融服务。与一大客户共创价值、共同成长。 中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行、经验丰富、服务优质、业绩突出。2004年被英国金球托管人》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,并获得民宿夏见的AS70审计报告、表明了独立公正第三方对中国农业银行任管服务运行流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设、品牌声誉进一步提升,在2010年首届"金牌制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设、品牌声誉进一步提升,在2010年首届"金牌 理时"10P10颁奖盛典"中成绩突出获 最佳托管银行"奖。2010年再次荣获 僧席财务官》杂志颁发的 最佳资产托管奖"。 中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004年9月更

,是不是,我们是办过风盛变红官部了1998年5月绘中国证监会和中国人民银行批准成立。2004年9月 约托管业务部内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券 生金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统 2、主要人员情况

基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司 基金托管人:中国农业银行股份有限公司

中国农业银行托管业务都现有员工140余名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称、精通国内外证券市场的运作。

3.基金托管业务经营情况 截止2014年9月30日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金块227只包括富 国天廊平衛混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大 大成景的等分。大成市场工程,更加工券投资基金、大成间新成长混合型证券投资基金、烧临同德主题增长股票型证券投资基金、大成市场工资投资基金、海市内需增长灵活配置混合型证券投资基金、汉盛证券投资基金、托盛成长价值证券投资基金、黑福证券投资基金、海市政治证券投资基金、丰富成长价值证券投资基金、大成价值业券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、投资和企业长发出专业。长度和自然全线推发,是

1、星钟的内容 名称·国海宫兰克林基金管理有限公司 注册地址:广西南宁市西乡塘区总部路1号中国-东盟科技企业孵化基地一期C-6栋二层 办公地址:上海浦东世纪大道8号上海国金中心二期9层 法定代表人;吴亚玲

客服电话:4007004518、95105680和021-3878 9555 联系人:王蓉婕

公司网址:www.ftsfund.com

公司例距www.lstund.com 2.代籍的机构 (1) 中国农业银行股份有限公司 住所北京市东城区建国门内大街69号 办公地址.北京市东城区建国门内大街69号 法定代表人.蒋超复 联系人规划一宁

(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

自活:010-66107900

注册地址:北京市复兴门内大街1号 法定代表人:田国立 客户服务电话:95566

答户服务电击95566公司附述www.boc.en (4)中国建设银行股份有限公司 注册地址北京市西域区金融大街25号 办公地址北京市西域区闹市口大街1号院1号楼 法定代表人王洪章

真:010-66275654 联系人:王琳 客户服务电话:95533

公司网址:www.ccb.com (5) 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:牛锡明 专直:021-58408483

关系人:曹榕 客户服务电话:95559 公司网址:www.bankcomm.com 6)招商银行股份有限公司 主册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦 法定代表人:傅育宁

户服务电话:95555 各一服夯电店59555 公司网站:www.cmbchina.com 7) 中信银行股份有限公司 注册地比北京市市京城区朝阳门北大街8号富华大厦C座 地比北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座 法定代表人:常振明

联系人:丰靖 客户服务电话:95558

答户服务电话:95558 公司网址:bank ecitic.com (8) 华夏银行股份有限公司 注册地址:北京市东城区建国门内大街22号 法定代表人,吴建 电话:010-85238667 5店:010-85238680 专真:010-85238680 关系人:郑鹏 3户服务电话:95577

等戶服务电站:95577 公司网址:www.hab.com.cn 9) 中国民生银行股份有限公司 注册地址:北京市西域区复兴门内大街2号 挂定代表人:董文标 专真:010-57092611

传真010-57092611 联系人物成茜 客户服务电话:95568 公司网址:www.cmbc.com.cn (10中国光大银行股份有限公司 注册地址:北京市西城区太平桥大街25号光大中心 按定代表人唐双宁 联系人李伟

联系人李伟 电话010-63636155 传真010-63630661 客产服务电话:9599 公司网址:www.cebbank.com (11)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

公司网址:www.spdb.com.cn (12)宁波银行股份有限公司 住所:宁波市鄞州区宁南南路700号 法定代表人:陆华裕

联系人:胡技勋 客户服务电话:96528(上海、北京地区962528) 公司网址:www.nbcb.com.cn

客户服务电话:4001196228

法定代表人:刘宝凤 联系人:王宏 传真:022-58316569 客户服务电话:400-888-8811 公司网址:www.cbhb.com.cn (15)杭州联合农村商业银行股份有限公司 法定代表人:张晨 联系人:姜鹏

电话:0571-87923324 专真:0571-87923214

主册地址:中国苏州市工业园区钟园路728号

客服电话:96067

客户服务电话:95563

法定代表人王常青 客户服务电话-400-8888-108 公司网址www.csc108.com (19)国泰君安证券股份有限公司 注册地址上梅市浦东新区商城路618号 办公地址上海市浦东新区银城中路168号 法定代表人:万建华 一服务电话:400-8888-666

法定代表人王开囯 电话301-2319000 传真01-23219100 联系人李笑鸣 客户服务电话95553或拨打各城市营业网点咨询电话 公司网肚www.htsec.com (2)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 注定代表人族有安 客户服务电话400-888-888

法定代表人陈有安 客户服务电话-400-888-8888 电话-010-66568430 联系人宋明 公司网址-www.chinastock.com.cn (22)兴业证券股份有限公司 注册地址-福州市湖东路268号 办公地址-上海浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层 客户服务电话-021-38162212 业务联系人夏中苏 公司网址-www.xyzl.com.cn

客户服务电话:95523、4008895523 联系人:邓寒冰

公司网址:www.newone.com.cn (25)中信证券股份有限公司 注册地址:"东省客圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座 法定代表人:王东明 专真:010-60833739

联系人:顾凌 客户服务电话:95548 专真:0531-68889357

客户服务电话:95538

专直:0731-4403439

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

办公地址:长春市自由大路1138号 法定代表人:矫正中 联系人:安岩岩 电话:0431-85096517 客户服务电话:400-600-0686

公司网址:www.nesc.cn (29)山西证券股份有限公司 注册地址:太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼 法定代表人:侯巍 担话:0351-8686659

专直:0351-8686619 玄户服务电话:400-666-1618.95573 公司网班:www.i618.com.cn (30)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 法定代表人募一兵

客户服务电话:0731-4403340 (3)公司以及通过19代23年 注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座505 法定代表人:林义相

专真:010-66045152 客户服务电话:010-66045678 联系人:尹伶 联系电话:010-66045608 关系电话:025-83364032 关系人:谷翔

专真:025-83320066 传真-025-83320066 客户服务电话-400-828-5888 公司阿拉:www.njaq.com.cn (33)中信证券排汇)有限责任公司 住所-浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19,20层 办公地址-浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22,23楼

公司网址:www.essence.com.en (37)中前证券有限公司 注册地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层 通讯地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层 法定代表人杜前 会成とは3-MJV-8000-70/ 公司附注:www.arisee.com.en/ (38)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 遠頂地址:安徽省合肥市寿春路179号 法定代表人蔡咏 申详の55、4800-800-800 联系人:陈琳琳 客户服务电话:400-8888-777或95578、安徽省内客服电话:96888 各市成为中记3-300-30067/1329/36、及底目75名公司附近www.gyzq.com.cn http://www.hisc.com.cn/39)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 进讯地址上海市黄浦区西藏中路336号 注定代表人来连 联系人来连 野东东东西 555,000 联系电话:021-53519888 客户服务电话:021–962518,4008–918–918(全国)http://www.htsc.com.cn/ 各广服が电话2/1-90216,4006-916-9公司网址:www.962518.com (40)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:薛峰 专真:021-22169134 |网址:www.ebscn.com http://www.htsc.com.cn/

法定代表人:沈强 联系人:李珊 联系电话:0571-87112507

34)牛拳业券股份有限公司 她上江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦 忠定代表人,吴万善 电话:025-83290979 专真,025-51863323 联系人:万鸣

联系人.万鸣 客户服务电话:95597 公司网址: www.htsc.com.cn (35)湘财证券股份有限公司 注册地址:湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼 办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务 法定代表人:陈学荣

联系人:刘晨、李芳芳 客户服务电话:10108998、400-888-8788、95525 旦话:0451-85863719 专真:0451-82287211 联系人:刘爽 客户服务电话:400-666-2288

公司网址:www.jhzq.com.cn (42)东海证券股份有限公司 注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层 办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦 法定代表人:刘化军 包括:021-20333910

客户服务电话:95531;400-888-8588

(下列:10 HL 20 KL 20 HK 2 HL 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 专真:0755-82133952 联系人:齐晓燕 客户服务电话: 95536

公司网址:www.guosen.com.c (44)宏源证券股份有限公司 主册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号 法定代表人:冯戎 专真:010-88085240 联系人:李巍 客户服务电话:4008-000-562(全国) 各)版为它后4000-000-302(主国)公司网班www.hysec.com (45)华宝证券有限责任公司 注册地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心57楼 法定代表人陈林

电话:021-687/8/90 传真:021-68778113 联系人:刘闻川 客户咨询电话:400-820-9898

公司网址:www.cnhbstock.com (46)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 联系人:张腾 客户服务电话:96326(福建省外加拨0591)

正可用地压纳从用部件移称8号长江证券大厦 按笔代表人。胡运钊 联系人李良 电话027-65799999 传真027-85481900 客户服务和线95579或4008-888-999 客户服务和线95579或4008-888-999 客户服务和线95579。com (48)上海华信证券有限责任公司 注册地址上海市清东新区世纪大道100号环球金融中心9楼 法定代表人杨始敏 电话021-38784818 传真021-68775878 联系人,很另 客户服务电话-021-68777877 公司网址.www.shluxq.com 答片账步电话021-6877877 公司附此www.shbxzq.com (49)中信证券(山东)有限责任公司 注册地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层 注定代表人,杨宝林 联系人,吴忠超

(51)上海大大基金销售有限公司 注册地址:上海市徐江区龙田路190号2号楼2层 法定代表人:其实 联系人:纳小丹 电话:201-54509998-7019 传真:021-64385308 客户服务电话:400-1818-188 少司殴址:www.1234567.com.cn 公、一次(Julianuvi 10.10-10.00 公司网址:www.1234567.com.cn (52)杭州歌水基金销售有限公司 办公地址浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼 法定代表人·陈柏肯 继考人,西维考

电话:0571-28829790

国海富兰克林基金管理有限公司 关于旗下基金投资资产支持证券方案及风险控制措施的公告

根据中国证监会 长于证券投资基金投资资产支持证券有关事项的通知》(证监基金字 **2006)**93号 要 国海富兰克林基金管理有限公司(以下简称 本公司)施下相关基金的基金合同规定,本公司曾理的 实林国海姆性市值股票型证券投资基金。富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金。富兰克林国海 价值股票型证券投资基金。富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金。富兰克林国海政是对股票 完接投资基金。富兰克林国海海化收益债券型证券投资基金。富兰克林国海政是对股票 条接投资基金。富兰克林国海河等现的指数增强型证券投资基金。富兰克林国海山等投资 、富兰克林国海第四报灵活配置混合型证券投资基金。富兰克林国海亚洲《除日本》机会股票型证券投资 、富兰克林国海第四报灵活配置混合型证券投资基金。富兰克林国海亚洲《除日本》机会股票型证券 20世界投資基金。高三見杯国海产你300情效增强型业券投资基金。高三兒林国海中小盛放票型业券投资 基金。富兰克林国海第酚但提克活色置18年型业券投资基金。富兰克林国海恒、19年日本 加全股票型证券 投资基金。富兰克林国海研究精选股票划证券投资基金。富兰克林国海自央(自用债券型证券投资基金。富兰 2克林国海县瓜塱动灵活起置混合型证券投资基金。富兰克林国海自即被查货市市场证券投资基金。富兰 5林国海发罗恒丰定期开放债券型证券投资基金。富兰克林国海恒利分级债券型证券投资基金。富兰克林 国海健康优质生活股票型证券投资基金可以投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持 证券。根据证券投资基金次、公开募集证券投资基金应信管理办法、净相关汇律法规定上述基金的基金 分同、招募说明书。便新,规定,特制定上述证券投资基金资产支持证券投资方案及风险控制措施,并公告 "下下"

以基項界明 以谨慎和风险可控为原则,根据本公司的投资能力和风控水平有选择地投资资产支持证券。通过对资产支持证券的信用风险、提前偿付风险、再投资风险的分析、结合对利率走势和底层资产质量变动趋势的判断、综合评估资产支持证券的风险收益特征以及相对投资价值,在此基础上做出相应的投资决策。——投资限制:

---、"投資限制: 本公司上述基金投资资产支持证券除遵守基金合同中已有的投资比例限制之外,还将遵守下述有关 资产支持证券投资比例的限制规定: 1.进只证券投资基金持有的同一《指同一信用级别》资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券 规模的10%。 2.单只证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该基金资产净值 的10%。 3.本管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过各类资产支持证券合计规模的10%。 4.单只证券给计规模的10%。 4.单只证券投资基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过该基金资产净值的20%,中国证监会规定的特殊品种除外。

规定的将标品件解析)。 5.因市场波动,基金规模变动等基金管理人之外的因素致使证券投资基金投资资产支持证券不符合 前述第2.第4项规定的比例,本基金管理人当在10个交易日内调整完毕。 6.货币市场基金刊投资于剩余期限在307天以内。含30天,附资产支持证券。债券基金,股票基金,混 合基金等其他类别的基金投资于资产支持证券的期限,依照中国证监会的相关规定和基金合同中的约定

执行。 浮动利率资产支持证券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算。 7.本公司旗下的证券投资基金投资的资产支持证券领具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评 级,应不低于国内信用评级机构评定的AAA级或相当于 AAA级的信用贸别,其他类别证券的信用评级,应不低于国内信用评级机构评定的AAA级或相当于 别限制,考基金合同未订明相应的证券信用级别限制,应投资于信用级别评级为BBB以上 含BBB 的资产 支持证券 间限制。否基金合同未订明相应的证券信用级划限制,应投资士信用级划评级为BBB以上 管BBB 和资产 支持证券。 8、本公司旗下的证券投资基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降,不再符合投资标准,应

风险。
1. 事前风险控制
固定收益部债券研究员对资产支持证券品种进行研究和分析,并根据信用质量、市场流动性等因素特征进行合理估值和定价,并遵守债券人库流程。建立可投资资产支持证券库。债券研究员充分分析资产支持证券发行人的财务状况、基础资产质量、外部信用等信用条件控制信用风险。针对提前偿付风险。债券研究员对资产支持证券进行个案分析,运用相关评价方法,充分揭示可能的提前偿付风险。基金经理根据对条本来利率水平变动的预期,构建资产支持证券的投资比例和投资期限,并在组合持有资产支持证券期间、

未来利率水平变动的预期,构建资产支持证券的投资比例和投资期限,并在组合持有资产支持证券期间,持续跟踪。进行优化调整。 2、事中风险控制 风险控制部在交易系统中设置相应的风险控制参数、实时控制资产支持证券投资的头寸、各项投资限制指标交易系统中设置相应的风险控制参数、实时控制资产支持证券投资的头寸、各项投资限制指标交易系统中设置相应的风险控制参数。实时控制资产支持证券投资的头寸、各项投资限制指标交易至根据市场状况监控资产支持证券投资指令的流动性风险,及时将市场流动性特征反馈给基金经理。 248. 3.事后风险控制 风险控制部每日对旗下所有组合投资资产支持证券进行监控和报告,对于不符合相关风险控制规则

的要求在规定即成为进行自治则整个规定的效应了关闭进步和1通过各种成合、对1个符合由大风险压制观处的要求在规定即取为进行自治则整风险控制部定期即指比较资支持证券的风险法权、提交给公司股资条 会会。债券研究员及时取器公司旗下组合持有的资产支持证券的信用风险、评级变化风险等。给予及时的风险提示、公司监察籍被职对投资资产支持证券可能涉及合规和法律风险进行管理和控制,并对上述风险控制企过程进行内部稽核。 四、信息披露方式 1.本公司将依法披露所管理的证券投资基金投资资产支持证券的情况,并保证所披露信息的真实性

1.本公司将依法披露所管理的证券投资基金投资资产支持证券的情况,并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。
2.本公司将在基金年报及半年报中披露持有的资产支持证券总额,资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。
3.本公司将在基金牵渡报告中披露共有的资产支持证券总额,资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。
五.风险揭示
本公司索诏以诚实信用,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,也不保证最低收益。投资者申购本公司旅下各基金时,应认真阅读各基金的基金合同,招募该明书和上述资产支持证券投资方案和风险控制措施。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险、本公司将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资,请基金份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的基金净值波动在内的各项风险。

国海富兰克林基金管理有限公司 2015年1月27日