(上接B62版)

法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82558305
传真:0755-82558355
联系人:陈剑虹
客户服务电话:400-8001-001
公司网址:www.essence.com.cn
33) 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:蔡咏
电话:0551-62246273
传真:0551-62272108
联系人:陈琳琳
客户服务电话:400-8888-777 或 95578、安徽省内客服电话:96888
公司网址:www.gyzq.com.cn
34) 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
办公地址:上海市黄浦区西藏中路 336 号
法定代表人:龚德雄
电话:021-53519888
传真:021-63608830
联系人:徐曼华
客户服务电话:021-962518,4008-918-918(全国)
公司网址:www.962518.com
35) 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
办公地址:上海市静安区新闸路 1508 号
法定代表人:薛峰
电话:021-22169999
传真:021-22169134
联系人:刘晨、李芳芳
客户服务电话: 95525
公司网址:www.ebscn.com
36) 江海证券有限公司
注册地址:哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
办公地址:哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
法定代表人:孙名扬
电话:0451-85863696
传真:0451-82287211
联系人:张背北
客户服务电话:400-666-2288
公司网址:www.jhzq.com.cn
37) 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:朱科敏
电话:021-20333910
传真:021-50498825
联系人:王一彦
客户服务电话:95531、400-888-8588
公司网址:www.longone.com.cn
38) 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
联系人:周杨
客户服务电话: 95536
公司网址:www.guosen.com.cn
39) 华宝证券有限责任公司
注册地址:上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 楼
办公地址:上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 楼
法定代表人:陈林
电话:021-68778090
传真:021-68778113
联系人:刘闻川
客户服务电话:400-820-9898
公司网址:www.cnhbstock.com
40) 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
办公地址:福州市五四路新天地大厦 7、8 层
法定代表人:黄金琳
电话:0591-83893286
传真:0591-87383610
联系人:徐松梅
客户服务电话: 96326(福建省外加拨 0591)
公司网址:www.hfzq.com.cn
41) 长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
办公地址:武汉市新华路特 8 号长江证券大厦
法定代表人:杨泽柱
电话:027-65799999
传真:027-85481900
联系人:奚博宇
客户服务电话:95579 或 4008-888-999
客户服务网站:www.95579.com
42) 中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层
办公地址:青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层
法定代表人:杨宝林
电话:0532-85022326
传真:0532-85022605
联系人:吴忠超
客户服务电话:95548
公司网址:www.citicssd.com
43) 上海华信证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼
法定代表人:杨锐敏
电话:021-38784818
传真:021-68775878
联系人:倪丹
客户服务电话:021-68777877
公司网址:www.shhxzq.com
44) 上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
办公地址:上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼
法定代表人:其实
联系人:潘世友
电话:021-54509988
传真:021-64385308
客户服务电话:400-1818-188
公司网址:www.1234567.com.cn
45) 杭州数米基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼
法定代表人:陈柏青
联系人:徐昳绯
电话:021-60897840
传真:0571-26697013
客户服务电话:4000-766-123
公司网址:www.fund123.cn
46) 上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号
办公地址:上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 9 楼
法定代表人:杨文斌
联系人: 张茹
电话:021-20613600
传真:021-6859 6916
客户服务电话:400-700-9665
公司网址: www.ehowbuy.com
47) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室
办公地址:上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12F
法定代表人:汪静波
联系人: 徐诚
电话:021-38509639
传真:021-38509777
客户服务电话:400-821-5399
公司网址:www.noah-fund.com
48) 深圳众禄基金销售有限公司
注册地址: 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼
办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼
法定代表人:薛峰
联系人: 童彩平
电话:0755-33227950
传真:0755-33227951
客户服务电话:4006-788-887
公司网址:www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com
49) 北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号
办公地址:北京市朝阳区德胜门外华严北里 2 号民建大厦 6 层
法定代表人:闫振杰
联系人:翟飞飞
电话:010-52703350-6006
传真:010-62020355
客户服务电话:400-888-6661
公司网址:www.myfund.com
50) 和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 1002 室
法定代表人:王莉
联系人:吴卫东
电话:021-20835787
传真:021-20835879
客户服务电话:400-920-0022
和讯理财客网址:licaike.hexun.com
51) 万银财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元
办公地址:北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201
法定代表人:王斐
联系人:张莉
电话: 010-53300532
传真:010-59393074
客户服务电话: 400-081-6655
公司网址:www.wy-fund.com
52) 上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
法定代表人:张跃伟
联系人:单丙烨
电话:021-2069 1832
传真:客户服务电话:400-820-2899
公司网址:www.erichfund.com
(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:吴显玲
电话:(021)3855 5511
传真:(021)68883050
联系人:胡昕彦
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海源泰律师事务所
住所:上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室
办公地址:上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 1405 室
负责人:廖海
联系电话:(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(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
办公地址:上海湖滨路 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: 单峰 沈兆杰

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的规定,已于 2015 年 4 月 16 日复核了本投资组合报告的内容。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截止 2015 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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	85,718,083.45	13.86
	其中:股票	85,718,083.45	13.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	508,246,348.80	82.19
	其中:债券	488,246,348.80	78.96
	资产支持证券	20,000,000.00	3.23
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	3,000,000.00	0.49
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,768,776.65	0.93
8	其他资产	15,648,849.83	2.53
9	合计	618,382,058.73	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	采矿业	-	-
C	制造业	41,626,470.66	8.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,280,313.04	1.51
J	金融业	25,978,512.00	5.41
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,866,707.75	1.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,966,080.00	1.03
S	综合	-	-
	合计	85,718,083.45	17.84

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	236,200	18,480,288.00	3.85
2	600079	人福医药	247,690	8,884,640.30	1.85
3	000651	格力电器	179,089	7,840,516.42	1.63
4	601166	兴业银行	408,400	7,498,224.00	1.56
5	002606	大连电瓷	402,407	7,416,361.01	1.54
6	002063	远光软件	181,826	7,280,313.04	1.51
7	000888	峨眉山 A	216,085	5,866,707.75	1.22
8	000860	顺鑫农业	236,907	5,375,419.83	1.12
9	000568	泸州老窖	213,400	5,236,836.00	1.09
10	601098	中南传媒	221,700	4,966,080.00	1.03

4. 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	45,123,317.20	9.39
	其中:政策性金融债	45,123,317.20	9.39
4	企业债券	318,006,957.20	66.17
5	企业短期融资券	30,212,000.00	6.29
6	中期票据	80,805,000.00	16.81
7	可转债	14,099,074.40	2.93
8	其他	-	-
9	合计	488,246,348.80	101.60

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018001	国开 1301	224,930	23,041,829.20	4.79
2	124049	12营沿海	219,900	22,601,322.00	4.70
3	124117	12宜城投	210,890	21,552,958.00	4.48
4	112217	14东江 01	210,000	21,550,200.00	4.48
5	140222	14国开 22	200,000	20,870,000.00	4.34

6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123588	禾燃气 02	100,000	10,000,000.00	2.08
2	123589	禾燃气 03	100,000	10,000,000.00	2.08

7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据基金合同,本基金不投资贵金属。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同,本基金不投资股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同,本基金不投资国债期货。

11.投资组合报告附注

1) 本基金本期投资的前十名证券中,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) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	103,494.30
2	应收证券清算款	2,910,419.13
3	应收股利	-
4	应收利息	12,500,438.20
5	应收申购款	134,498.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,648,849.83

4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	8,151,092.60	1.70
2	110028	冠城转债	2,308,248.30	0.48
3	125089	深机转债	736,300.00	0.15
4	128008	齐峰转债	313,870.80	0.07
5	128007	通鼎转债	60,913.60	0.01

5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000860	顺鑫农业	5,375,419.83	1.12	重大事项未公布

十三、基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

截止到 2015 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:

(一)富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金[A 类]

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
2008年10月24日—2008年12月31日	3.25%	0.17%	2.93%	0.11%	0.32%	0.06%
2009年1月1日—2009年12月31日	2.23%	0.19%	-0.84%	0.06%	3.07%	0.13%
2010年1月1日—2010年12月31日	3.95%	0.20%	-0.87%	0.10%	4.82%	0.10%
2011年1月1日—2011年12月31日	-0.56%	0.27%	2.52%	0.11%	-3.08%	0.16%
2012年1月1日—2012年12月31日	8.59%	0.17%	-0.67%	0.07%	9.26%	0.10%
2013年1月1日－2013年12月31日	0.16%	0.17%	-5.28%	0.11%	5.44%	0.06%
2014年1月1日－2014年12月31日	18.15%	0.24%	7.48%	0.15%	10.67%	0.09%
2015年1月1日－2015年3月31日	6.41%	0.33%	-0.56%	0.12%	6.97%	0.21%
2008年10月24日－2015年3月31日	49.19%	0.21%	4.29%	0.11%	44.90%	0.10%

(二)富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金[C 类]

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
2008年12月18日—2008年12月31日	0.13%	0.10%	0.51%	0.10%	-0.38%	0.00%
2009年1月1日—2009年12月31日	2.02%	0.19%	-0.84%	0.06%	2.86%	0.13%
2010年1月1日—2010年12月31日	3.84%	0.20%	-0.87%	0.10%	4.71%	0.10%
2011年1月1日—2011年12月31日	-0.83%	0.27%	2.52%	0.11%	-3.35%	0.16%
2012年1月1日—2012年12月31日	8.33%	0.17%	-0.67%	0.07%	9.00%	0.10%
2013年1月1日－2013年12月31日	-0.14%	0.17%	-5.28%	0.11%	5.14%	0.06%
2014年1月1日－2014年12月31日	17.99%	0.24%	7.48%	0.15%	10.51%	0.09%
2015年1月1日－2015年3月31日	6.43%	0.33%	-0.56%	0.12%	6.99%	0.21%
2008年12月18日－2015年3月31日	42.91%	0.21%	1.85%	0.11%	41.06%	0.10%

十四、基金的费用概述

(一)基金运作费用

1、基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费;
(2)基金托管人的托管费;
(3)销售服务费;
(4)基金合同生效后的信息披露费用;
(5)基金份额持有人大会费用;
(6)基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
(7)基金的证券交易费用;
(8)基金财产拨划支付的银行费用;
(9)按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

2、上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照合理的价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

3、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为 0.6%
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

(2)基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为 0.2%
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

(3)销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额收取销售服务费年费率为 0.3%。本基金销售服务费将专门用于本基金 C 类的销售与基金份额持有人服务,基金管理人将在基金年度报告中对该费用的列支情况作专项说明。

在通常情况下,销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.3%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.3%÷当年天数
H 为每日应计提的销售服务费
E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,基金管理人收到后按照与销售机构的销售协议的约定分别支付给各销售机构。

(4)上述 1 中(4)到(7)项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

4、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的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。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付,基金收取认购费的,可以从认购费中列支。

5、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和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。调高基金管理费率和基金托管费率,须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前两个工作日在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

(二)基金销售费用

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书"第六部分 基金的募集"中"七、认购方式与费率结构"中的相关规定。本基金申购费、赎回费、转换费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书"第八部分 基金份额的申购与赎回"中的"六、申购和赎回的价格、费用及其用途"和"十一、基金转换"中的相关规定。

(三)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十五、对招募说明书更新部分的说明

1、"重要提示"一章中更新了本招募说明书(2015 年第 1 号)所载内容截止日及有关财务数据和净值表现截止日。

2、"基金管理人"一章相关内容更新如下:

(1) 更新了董事长吴显玲女士的信息;
(2)更新了副董事长阮博文(William Y. Yun)先生的信息;
(3)删去了董事张雅锋女士的信息;
(4)新增了董事何春梅女士的信息;
(5)更新了董事麦敬恩(Gregory E. McGowan)先生的信息;
(6)删去了董事齐国旗先生的信息;
(7)更新了董事胡德忠先生的信息;
(8)新增了董事燕文波先生的信息;
(9)更新了董事张伟先生的信息;
(10)更新了独立董事张忠国先生的信息;
(11)更新了独立董事陈伟力女士的信息;
(12)更新了独立董事洪荣光先生的信息;
(13)更新了独立董事徐同女士的信息;
(14)更新了监事会主席余天丽女士的信息;
(15)更新了监事刘俊红女士的信息;
(16)更新了职工监事张志强先生的信息;
(17)删去了副总经理张晓东先生的信息;
(18)更新了基金经理刘怡敏女士的信息;
(19)更新了投资决策委员会成员信息。

3、"基金托管人"一章更新了基金托管人部分信息。

4、"相关服务机构"一章更新如下:

(1)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:

更新了中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、工商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、杭州联合农村商业银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、国海证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司 、东北证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司、华泰证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司 、华福证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司、南京证券股份有限公司、中航证券有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、上海华信证券有限责任公司、深圳众禄基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、北京展恒基金销售有限公司、万银财富(北京)基金销售有限公司代销机构的信息。

(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:

更新了中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、工商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、杭州联合农村商业银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、国海证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司 、东北证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、天相投资顾问有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司、华泰证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司 、华福证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、上海华信证券有限责任公司、上海天天基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司 、和讯信息科技有限公司、万银财富(北京)基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司代销机构的信息。

5、在"基金份额的申购与赎回"一章中更新了申购与赎回的场所和申购和赎回的价格、费用及其用途信息。

6、在"基金的投资基金投资组合报告"一章中,更新了本基金最近一期投资组合的内容,内容更新到 2015 年 3 月 31 日。

7、在"基金的业绩"一章中,更新了基金合同生效以来至 2015 年 3 月 31 日的本基金投资业绩。

8、在"对基金份额持有人的服务"一章中,更新了对资料寄送的服务内容。

9、更新了"其他应披露事项"一章中自上次招募说明书披露以来涉及本基金的相关公告。

国海富兰克林基金管理有限公司
2015 年 6 月 5 日

证券代码:000856 证券简称:冀东装备 公告编号:2015-27

唐山冀东装备工程股份有限公司
2015年第二次临时股东大会决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

特别提示:

1.本次股东大会未出现否决议案的情形。

2.本次股东大会存在变更前次股东大会决议的情况:2015年5月12日,公司召开2014年年度股东大会,审议《公司与控股股东及其子公司发生的日常经营性关联交易预计的议案》,本公司董事会对上述议案再次提交股东大会进行审议。

一、会议召开和出席情况

(一)会议的召开情况

1.召开时间:

(1)现场会议召开时间:2015年6月4日 下午2:00

(2)网络投票时间:通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的时间为2015年6月4日(星期四)9:30-11:30,13:00-15:00(股票交易时间)

通过深圳证券交易所互联网投票系统投票的时间为2015年6月3日 (星期三)15:00至2015年6月4日(星期四)15:00期间的任意时间。

2.召开地点:冀东发展集团有限责任公司会议室(河北省唐山市丰润区林荫路233号)。

3.召开方式:现场投票与网络投票相结合的方式。

4.召集人:公司董事会

5.主持人:董事长张增光先生

6.会议的召开符合《公司法》、《股票上市规则》及《公司章程》的相关规定。

(二)会议的出席情况

1.出席的总体情况:

出席本次股东大会的股东及股东授权委托代表(以下统称股东)64人,代表股份116,084,580股,占公司有表决权股份总数的51.1386%。

2.现场会议出席情况:

出席本次股东大会现场会议的股东(代理人)3人,代表股份94,946,421股、占公司有表决权股份总数的41.8266%。

3.网络投票情况:

本次股东大会通过网络投票出席会议的股东61人,代表股份21,138,159股,占公司有表决权股份总数的9.3120%。

4.外资股东出席情况:

公司未发行境内、外上市外资股。

5.其他人员出席会议情况

公司全体董事、监事、高级管理人员、见证律师列席了本次股东会议。

二、议案审议表决情况

审议了公司与控股股东及其子公司发生的日常经营性关联交易预计的议案。该项议案为关联交易,关联股东冀东发展集团有限责任公司所持表决权股份91,978,421股,回避表决。

1.表决情况:同意14,366,430股,占出席会议有效表决权股份总数的59.5965%;反对9,739,729股,占出席会议有效表决权股份总数的40.4035%;弃权0股,占出席会议有效表决权股份总数的0.000%。

持有公司5%以下股份的中小股东表决情况:

同意14,366,430股,占出席会议持有公司5%以下股份的中小股东有效表决权股份总数的59.5965%;反对9,739,729股,占出席会议持有公司5%以下股份的中小股东有效表决权股份总数的40.4035%;弃权0股,占出席会议持有公司5%以下股份的中小股东有效表决权股份总数的0.0000%。

2.表决结果:获得出席会议的股东有效表决权股份总数的1/2以上通过,通过了该项议案。

三、律师出具的法律意见

1.律师事务所名称:北京市天元律师事务所。

2.律师姓名:张征、李然。

3.本所律师认为,公司本次股东大会的召集、召开程序符合有关法律、行政法规、《上市公司股东大会规则》及《公司章程》的有关规定;本次股东大会会议出席人员的资格、召集人的资格合法有效;本次股东大会的表决程序和表决结果合法有效。

四、备查文件

1.唐山冀东装备工程股份有限公司2015年第二次临时股东大会决议;

2.北京市天元律师事务所出具的《关于唐山冀东装备工程股份有限公司2015年第二次临时股东大会的法律意见》。

唐山冀东装备工程股份有限公司
董事会
2015年6月4日

华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金
关于基金份额折算的公告

根据《华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,华润元大基金管理有限公司(以下简称"本基金管理人")决定对华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金")进行基金份额折算与变更登记,并决定2015年6月10日为本基金的基金份额折算日(T日)。现将有关事项公告如下:

一、折算对象

基金份额折算日在本基金登记结算机构登记在册的本基金基金份额。

二、折算方式

本次基金份额折算后,本基金基金份额净值与基金份额折算日中创100指数收盘值的千分之一基本一致。

1、基金份额折算程序与计算公式

(1)基金管理人确定基金份额折算日(T日),并提前公告。

(2)T 日收市后,基金管理人计算当日的基金资产净值X、折算前基金份额总额Y,并与基金托管人进行核对。

(3)假设T 日标的指数收盘值为I,则T日的目标基金份额净值为I/1000,基金份额折算比例的计算公式为:

$$折算比例=\frac{X/Y}{I/1000}$$

,以四舍五入的方法保留小数点后8位。

(4)基金管理人根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行折算,折算后的基金份额计算至整数位(小数部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产),加总得到折算后的基金份额总额。

(5)登记结算机构根据基金管理人提供的数据为基金份额持有人进行基金份额的变更登记。

(6)基金管理人、基金托管人根据折算后的基金份额总额,进行相应的会计处理,计算T日折算后的基金份额净值,并互相核对。

(7)在登记结算机构完成份额折算和变更登记后的3个工作日内,投资人可以在其办理认购的销售网点查询折算后其持有的基金份额。

2、基金份额折算的举例

假设某投资人在基金募集期内认购了5,000份,基金份额折算日的基金资产净值为3,600,000,000.95元,折算前的基金份额总额为3,500,057,000份,当日标的指数收盘值为3638.47。

(1)折算比例=(3,600,000,000.95/3,500,057,000)/(3638.47/1000)=0.28268878

(2)该投资人折算后的基金份额=5,000×0.28268878=1413(小数部分四舍五入)

三、重要提示

基金份额折算后,本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额将发生调整,但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额折算对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额折算后,基金份额持有人将按照折算后的基金份额享有权利并承担义务。如果基金份额折算过程中发生不可抗力,本基金管理人可延迟办理基金份额折算与变更登记。投资者持有的基金份额以中国证券登记结算有限公司最终处理的方式和确认的数据为准。

风险提示: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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其将来表现。投资有风险,敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件,并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

华润元大基金管理有限公司
2015年6月5日

股票简称:国信证券 证券代码:002736 编号:2015-074

国信证券股份有限公司
2015 年 5 月主要财务信息公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

根据中国证监会《关于加强上市证券公司监管的规定》(2010 年修订),现披露公司 2015 年 5 月主要财务数据。

提请关注事项如下:

1、披露范围:本公司母公司财务数据。

2、相关数据未经审计,且为非合并数据,最终数据以公司定期报告为准。

国信证券 2015 年 5 月主要财务数据(未审计母公司数)

单位:万元

2015年5月		2015年1-5月		2015年5月31日
营业收入	净利润	营业收入	净利润	净资产
325,017.22	163,173.17	1,285,217.72	649,186.51	3,738,333.87

特此公告。

国信证券股份有限公司董事会
2015 年 6 月 5 日

证券代码:600503 证券简称:华丽家族 公告编号:临2015-068

华丽家族股份有限公司
关于收到《中国证监会行政许可申请受理通知书》的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

华丽家族股份有限公司(以下简称"公司"或"本公司")于2015年6月4日收到中国证券监督管理委员会 (以下简称" 中国证监会")《中国证监会行政许可申请受理通知书》(151336 号)。中国证监会依法对本公司提交的《上市公司非公开发行股票》行政许可申请材料进行了审查,认为该申请材料齐全,符合法定形式,决定对该行政许可申请予以受理。

公司本次非公开发行股票事项尚需获得中国证监会的核准,能否获得核准尚存在不确定性,敬请广大投资者注意投资风险。公司董事会将根据本次非公开发行股票事项的后续进展情况,及时履行信息披露义务。

特此公告。

华丽家族股份有限公司
董事会
二〇一五年六月四日

证券代码:002523 证券简称:天桥起重 公告编号:2015-046

株洲天桥起重机股份有限公司关于发行股份及支付现金购买资产事项获得中国证监会上市公司并购重组委员会无条件审核通过暨股票复牌的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

株洲天桥起重机股份有限公司(以下简称"公司")于2015年6月4日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")通知,经中国证监会上市公司并购重组审核委员会于2015年6月4日召开的2015年第46次并购重组委工作会议审核,公司发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金暨关联交易事项获得无条件审核通过。

根据《上市公司重大资产重组管理办法》等规定,公司股票(股票简称:天桥起重,股票代码:002523)自2015年6月5日开市起复牌。目前,公司尚未收到中国证监会的正式核准文件,待收到中国证监会相关核准文件后公司将另行公告。敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告!

株洲天桥起重机股份有限公司董事会
2015年6月4日

证券代码:601198 股票简称:东兴证券 公告编号:临2015-022

东兴证券股份有限公司
重大事项停牌公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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 。

因公司拟筹划非公开发行股票重大事项,鉴于该事项存在不确定性,为保证公平信息披露,维护投资者利益,避免造成公司股票价格异常波动,经公司申请,公司股票自2015年6月5日起停牌。

公司将按照《上市公司证券发行管理办法》、《上海证券交易所上市规则》及《关于规范上市公司筹划非公开发行股份停复牌及相关事项的通知》等相关规定,尽快确定是否进行上述重大事项,并于股票停牌之日起的5个交易日内(含停牌当日)公告进展情况,敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

东兴证券股份有限公司
董事会
2015年6月5日