# 富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金

## 2015 第二季度 报告

2015年6月30日

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

报告送出日期:2015年7月21日

### §1 重要提示

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 国富弹性市值股票 |
| 基金主代码 | 450002 |
| 交易代码 | 450002 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2006年6月14日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,164,869,390.02份 |
| 投资目标 | 本基金以富兰克林邓普顿投资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。 |
| 投资策略 | 资产配置策略:<br>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。<br>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。<br>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。<br>股票选择策略:<br>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本基金投资组合的基础,在此基础上,再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。<br>债券投资策略:<br>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。 |
| 业绩比较基准 | 70%×MSCI中国A股指数+ 25%×中债国债总指数(全价)+ 5%×同业存款息率 |
| 风险收益特征 | 本基金是一只主动投资的股票型基金,属于股票型基金中的中高风险品种,本基金的风险与预期收益都高于混合型基金。 |
| 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 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2015年4月1日-2015年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 747,987,951.69 |
| 2.本期利润 | 540,506,473.84 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.3757 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,199,643,326.86 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.8883 |

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

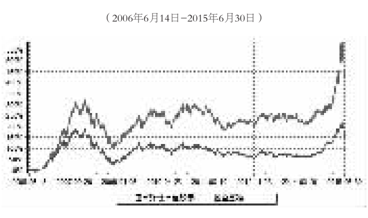
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 19.56% | 2.70% | 9.24% | 1.83% | 10.32% | 0.87% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2006年6月14日-2015年6月30日)



注:本基金的基金合同生效日为2006年6月14日。本基金在6个月建仓期结束时,各项投资比例符合基金合同约定。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 赵晓东 | 公司权益投资总监,国富中小盘股票基金、国富焦点驱动混合基金和国富弹性市值股票基金的基金经理 | 2014年12月19日 | — | 11年 | 赵晓东先生,香港大学MBA。历任淄博矿业集团项目经理,浙江证券分析员,上海交大高新技术股份有限公司高级投资经理,国海证券有限责任公司行业研究员,国海富兰克林基金管理有限公司研究员、高级研究员、国富弹性市值股票基金和国富潜力组合股票基金的基金经理助理,国富沪深300指数增强基金基金经理。截止本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司权益投资总监,国富中小盘股票基金、国富焦点驱动混合基金和国富弹性市值股票基金的基金经理。 |

注:

1. 表中"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期,其中,首任基金经理的"任职日期"为基金合同生效日。

2. 表中"证券从业年限"的计算标准为该名员工从事过的所有诸如基金、证券、投资等相关金融领域的工作年限的总和。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和《富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司在研究报告发布公平性、投资决策独立性、交易公平分配、信息隔离等方面均能严格执行《公平交易管理制度》,严格按照制度要求对异常交易进行控制和审批。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格按照《异常交易监控与报告制度》和《同日反向交易管理办法》对异常交易进行监控。报告期内公司不存在投资组合之间发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度,整个权益市场出现了先大幅上涨后大幅回调的走势,创业板和中小板波动明显高于主板,中小板和创业板公司收益相对较高。二季度,沪深300指数上涨10.41%,而创业板综合指数上涨30.95%。二季度,央行继续延续了较为宽松的货币政策,资本市场保持了较好的流动性,场外资金继续大量涌入股票市场,尤其是小市值的公司,这些资金通过配资等形式提高了资本市场的杠杆率,市场的波动开始加大,特别是六月开始,市场的波动给杠杆投资者带来了较大的影响,市场去杠杆出现加速现象。从宏观经济看,二季度经济的增长仍然处于增速相对下滑的态势,出口和投资对经济的贡献在降低,经济转型正在缓慢推进,由于资本增值带来的消费提升,对经济起到了一定的支撑作用。

二季度,本基金从长期投资的角度出发,提升国企改革标的配置,组合中中小和中大市值公司的比例较均衡,组合的配置更加稳健。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为1.8883元,本报告期份额净值上涨19.56% ,同期业绩基准上涨9.24%,基金净值领先业绩基准10.32%。本基金行业配置较多的食品饮料和中小市值公司是跑赢业绩基准的主要原因。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### §5 投资组合报告

5.1 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 | 2,049,261,347.56 | 90.71 |
| | 其中:股票 | 2,049,261,347.56 | 90.71 |
| 2 | 基金投资 | — | — |
| 3 | 固定收益投资 | — | — |
| | 其中:债券 | — | — |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 4 | 贵金属投资 | — | — |
| 5 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 6 | 买入返售金融资产 | — | — |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | — | — |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 203,476,967.11 | 9.01 |
| 8 | 其他资产 | 6,292,159.33 | 0.28 |
| 9 | 合计 | 2,259,030,474.00 | 100.00 |

5.2 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 | 60,560,766.13 | 2.75 |
| C | 制造业 | 1,302,428,935.95 | 59.21 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 35,440,252.88 | 1.61 |
| E | 建筑业 | 21,197,036.68 | 0.96 |
| F | 批发和零售业 | 30,847,371.84 | 1.40 |
| 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 | 126,415,070.22 | 5.75 |
| J | 金融业 | 209,301,913.26 | 9.52 |
| K | 房地产业 | 36,390,000.00 | 1.65 |
| L | 租赁和商务服务业 | 84,729,645.60 | 3.85 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 207,891.34 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 141,742,463.66 | 6.44 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | — | — |
| P | 教育 | — | — |
| Q | 卫生和社会工作 | — | — |
| R | 文化、体育和娱乐业 | — | — |
| S | 综合 | — | — |
| | 合计 | 2,049,261,347.56 | 93.16 |

5.3 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 | 000858 | 五粮液 | 4,945,262 | 156,764,805.40 | 7.13 |
| 2 | 000568 | 泸州老窖 | 4,759,485 | 155,206,805.85 | 7.06 |
| 3 | 300070 | 碧水源 | 2,905,154 | 141,742,463.66 | 6.44 |
| 4 | 002553 | 南方轴承 | 8,558,576 | 126,067,824.48 | 5.73 |
| 5 | 600400 | 红豆股份 | 6,773,225 | 97,060,314.25 | 4.41 |
| 6 | 000061 | 农产品 | 4,153,414 | 84,729,645.60 | 3.85 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 1,031,777 | 84,543,807.38 | 3.84 |
| 8 | 600079 | 人福医药 | 2,222,414 | 82,340,438.70 | 3.74 |
| 9 | 600305 | 恒顺醋业 | 2,601,532 | 78,540,251.08 | 3.57 |
| 10 | 601166 | 兴业银行 | 4,129,523 | 71,234,271.75 | 3.24 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,425,821.31 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,293,099.24 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 40,410.10 |
| 5 | 应收申购款 | 1,532,828.68 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 6,292,159.33 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期间的可转债。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 002553 | 南方轴承 | 126,067,824.48 | 5.73 | 重大事项重组 |

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,689,564,005.24 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 136,486,484.97 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 661,181,100.19 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | — |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,164,869,390.02 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 22,402,317.82 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | — |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | — |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 22,402,317.82 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 1.92 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内未有基金管理人运用固有资金投资本公司管理的该基金的情况。

### §8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、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设立的文件;

2、《富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金基金合同》;

3、《富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金托管协议》;

5、中国证监会要求的其他文件。

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所并登载于基金管理人网站:www.ftsfund.com。

8.3 查阅方式

1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅,并可按工本费购买复印件。

2、登陆基金管理人网站www.ftsfund.com 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

二〇一五年七月二十一日

---

# 富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金

## 2015 第二季度 报告

2015年6月30日

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

报告送出日期:2015年7月21日

### §1 重要提示

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 国富成长动力股票 |
| 基金主代码 | 450007 |
| 交易代码 | 450007 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年3月25日 |
| 报告期末基金份额总额 | 175,067,054.90份 |
| 投资目标 | 本基金重点投资于具有内生性增长和外延式扩张的积极成长型企业,在合理控制风险的基础上,力求实现基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 大类资产配置:<br>本基金管理人将以大类资产的预期收益率、风险水平和它们之间的相关性为出发点,对于可能影响资产预期风险、收益率和相关性的因素进行综合分析和动态跟踪,据此制定本基金在股票、债券和货币市场工具等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,并进行定期或不定期的调整,以达到控制风险、增加收益的目的。<br>股票选择策略:<br>本基金在适度的大类资产配置的基础上运用"精选成长股"的股票投资策略。<br>本基金股票的选择分为三个层次:首先,成长型筛选是针对企业历史财务指标,应用数量模型筛选股票,连同研究员实地调研推荐的部分股票,建立备选股票库;其次,对备选股票库的股票应用估值模型进行价值评估;最后,对投资目标的商业模式进行分析,找出未来成长的动力,进行整体优化,选择股票投资组合。<br>债券投资策略:<br>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。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。<br>权证投资策略:<br>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债券所分离的权证。 |
| 业绩比较基准 | 85%×沪深300指数+ 10%×中债国债总指数(全价)+ 5%×同业存款息率 |
| 风险收益特征 | 本基金是股票型基金,属于较高收益,较高风险的投资品种。 |
| 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 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2015年4月1日-2015年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 117,038,493.82 |
| 2.本期利润 | 60,999,944.64 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.2441 |
| 4.期末基金资产净值 | 340,246,881.83 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.9435 |

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

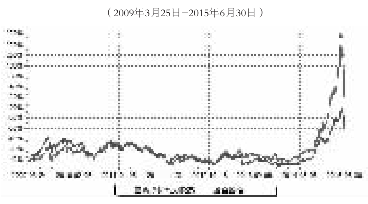
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 4.91% | 3.08% | 9.22% | 2.22% | -4.31% | 0.86% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009年3月25日-2015年6月30日)



注:本基金的基金合同生效日为2009年3月25日。本基金在6个月建仓期结束时,各项投资比例符合基金合同约定。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 卫学海 | 国富深化价值股票基金和国富成长动力股票基金基金经理 | 2015年5月25日 | — | 11年 | 卫学海先生,复旦大学工程硕士。历任中国人保资产管理有限公司高级投资经理,长城证券有限责任公司高级投资经理,光大证券资产管理有限公司投资经理。截止本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富深化价值股票基金和国富成长动力股票基金基金经理。 |
| 刘伟亭 | 公司行业研究主管,国富成长动力股票基金的基金经理 | 2011年7月27日 | 2015年5月25日 | 10年 | 刘伟亭先生,复旦大学经济学硕士。历任长江巴黎百富勤证券有限责任公司企业融资部助理经理,资本市场部业务主任和首席债券交易员,国海富兰克林基金管理有限公司研究员,高级研究员,行业研究主管,国富弹性市值股票基金和国富深化价值股票基金的基金经理助理,国富成长动力股票基金的基金经理。 |

注:

1. 表中"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期,其中,首任基金经理的"任职日期"为基金合同生效日。

2. 表中"证券从业年限"的计算标准为该名员工从事过的所有诸如基金、证券、投资等相关金融领域的工作年限的总和。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和《富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司在研究报告发布公平性、投资决策独立性、交易公平分配、信息隔离等方面均能严格执行《公平交易管理制度》,严格按照制度要求对异常交易进行控制和审批。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格按照《异常交易监控与报告制度》和《同日反向交易管理办法》对异常交易进行监控。报告期内公司不存在投资组合之间发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

市场在二季度先扬后抑,五月至六月初期"互联网+"大放异彩,以创业板为首的小盘股涨幅大幅超过大盘股,而六月中后期受利率上行、证监会清查场外配资、希腊债务危机影响,股指大幅下挫,大盘股跌幅小于中小盘股,市场振幅巨大,二季度沪深300指数上涨10.41%,延续一季度上涨态势。本轮行情主要由于短期流动性、政策风险溢价和公司治理相对改善的推动,"新兴产业"依然占优,市场风格明显偏好小盘成长股。板块方面,计算机、传媒、纺织服装等行业表现较好,传统和周期行业等表现较弱。

一季度底我们在行业配置结构上进行了大幅调整,小幅增加了TMT等行业的配置比例,行业配置更加均衡,更倾向于二线成长股,同时我们在二季度保持了较高的股票仓位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2015年二季度,基金净值上涨4.91%,业绩基准上涨9.22%,基金跑输业绩基准4.31个百分点。市场波动较大和持有停牌股票较多是本季度基金业绩跑输业绩基准的主要原因。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### §5 投资组合报告

5.1 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 | 278,940,307.43 | 74.18 |
| | 其中:股票 | 278,940,307.43 | 74.18 |
| 2 | 基金投资 | — | — |
| 3 | 固定收益投资 | — | — |
| | 其中:债券 | — | — |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 4 | 贵金属投资 | — | — |
| 5 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 6 | 买入返售金融资产 | — | — |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | — | — |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 52,730,875.65 | 14.02 |
| 8 | 其他资产 | 44,356,498.64 | 11.80 |
| 9 | 合计 | 376,027,681.72 | 100.00 |

5.2 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 | 124,915,316.90 | 36.71 |
| 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 | 96,447,046.53 | 28.35 |
| J | 金融业 | — | — |
| K | 房地产业 | 29,625,024.00 | 8.71 |
| L | 租赁和商务服务业 | 27,952,920.00 | 8.22 |
| M | 科学研究和技术服务业 | — | — |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | — | — |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | — | — |
| P | 教育 | — | — |
| Q | 卫生和社会工作 | — | — |
| R | 文化、体育和娱乐业 | — | — |
| S | 综合 | — | — |
| | 合计 | 278,940,307.43 | 81.98 |

5.3 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 | 000024 | 招商地产 | 811,200 | 29,625,024.00 | 8.71 |
| 2 | 300010 | 立思辰 | 856,348 | 24,423,044.96 | 7.18 |
| 3 | 600687 | 刚泰控股 | 595,400 | 23,369,450.00 | 6.87 |
| 4 | 300255 | 常山药业 | 810,269 | 22,347,219.02 | 6.57 |
| 5 | 002368 | 太极股份 | 382,783 | 20,184,147.59 | 5.93 |
| 6 | 000061 | 农产品 | 869,900 | 17,745,960.00 | 5.22 |
| 7 | 300168 | 万达信息 | 312,934 | 15,371,318.08 | 4.52 |
| 8 | 300101 | 振芯科技 | 267,022 | 14,846,423.20 | 4.36 |
| 9 | 002268 | 卫士通 | 166,700 | 13,359,338.00 | 3.93 |
| 10 | 002396 | 星网锐捷 | 414,994 | 13,321,307.40 | 3.92 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 205,668.07 |
| 2 | 应收证券清算款 | 42,714,683.40 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 7,950.54 |
| 5 | 应收申购款 | 1,428,196.63 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 44,356,498.64 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期间的可转债。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000024 | 招商地产 | 29,625,024.00 | 8.71 | 重大事项停牌 |
| 2 | 300255 | 常山药业 | 22,347,219.02 | 6.57 | 重大事项停牌 |
| 3 | 002368 | 太极股份 | 20,184,147.59 | 5.93 | 重大事项停牌 |
| 4 | 002268 | 卫士通 | 13,359,338.00 | 3.93 | 重大事项停牌 |

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 262,658,256.35 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 186,694,750.62 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 274,285,952.07 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | — |
| 报告期期末基金份额总额 | 175,067,054.90 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 14,866,686.49 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | — |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 14,866,686.49 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | — |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | — |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 转换转出 | 2015年6月2日 | -7,430,000.00 | -20,110,781.00 | 0.00% |
| 2 | 赎回 | 2015年6月12日 | -7,436,686.49 | -20,033,689.74 | 0.00% |
| 合计 | | | -14,866,686.49 | -40,144,470.74 | |

### §8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金设立的文件;

2、《富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金基金合同》;

3、《富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金招募说明书》;

4、《富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金托管协议》;

5、中国证监会要求的其他文件。

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所并登载于基金管理人网站:www.ftsfund.com。

8.3 查阅方式

1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅,并可按工本费购买复印件。

2、登陆基金管理人网站www.ftsfund.com 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

二〇一五年七月二十一日

---

# 富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金

## 2015 第二季度 报告

2015年6月30日

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
报告送出日期:2015年07月21日

### §1 重要提示

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 国富恒久信用债券 | |
| 基金主代码 | 450018 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2012年09月11日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 42,064,811.61份 | |
| 投资目标 | 在有效控制风险并保持资产流动性的基础上,通过积极的投资管理,追求基金资产的长期稳健增值,力争获取超越业绩比较基准的投资收益。 | |
| 投资策略 | 1、资产配置策略<br>本基金通过综合分析国内外宏观经济形势、利率走势、资金供求关系、证券市场走势、流动性风险、信用风险和有关政策法规等因素,研判各类属固定收益类资产的预期收益和预期风险,确定各类金融资产的配置比例。<br>2、固定收益类资产投资策略<br>本基金将灵活运用利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、相对价值判断等多重投资策略,构建以信用债券为主的固定收益类资产组合。 | |
| 业绩比较基准 | 60%×中债企业债总全价指数收益率+ 40%×中债国债总全价指数收益率 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。 | |
| 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 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 国富恒久信用债券A类 | 国富恒久信用债券C类 |
| 下属两级基金的交易代码 | 450018 | 450019 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 36,840,637.66份 | 5,224,173.95份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2015年04月01日-2015年06月30日) | |
|---|---|---|
| | 国富恒久信用债券A类 | 国富恒久信用债券C类 |
| 1.本期已实现收益 | 382,874.74 | 38,361.17 |
| 2.本期利润 | 487,119.62 | 41,315.62 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0130 | 0.0098 |
| 4.期末基金资产净值 | 45,347,699.22 | 6,384,875.86 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.231 | 1.222 |

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国富恒久信用债券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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.07% | 0.04% | 1.00% | 0.11% | 0.07% | -0.07% |

国富恒久信用债券C类

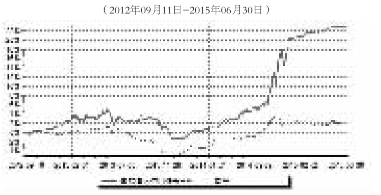
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.99% | 0.04% | 1.00% | 0.11% | -0.01% | -0.07% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国富恒久信用债券A类

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

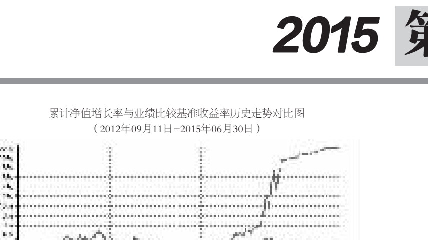
(2012年09月11日-2015年06月30日)



国富恒久信用债券C类

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年09月11日-2015年06月30日)



注:本基金的基金合同生效日为2012年9月11日。本基金在6个月建仓期结束时,各项投资比例符合基金合同约定。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刁晖宇 | 公司固定收益投资总监,QDII投资总监,国富恒久信用债券基金和国富恒利分级债券基金的基金经理 | 2012年09月11日 | | 17年 | 刁晖宇先生,美国堪萨斯大学工商管理硕士、美国南方卫理公会大学工程学硕士。历任美国景顺基金管理公司基金经理,美国Security Benefit Group资深投资分析师,Federal Home Loan Bank资深金融风险及金融衍生产品分析师,湖南中期广州营业部负责人。截止本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司固定收益投资总监,QDII投资总监,国富恒久信用债券基金和国富恒利分级债券基金的基金经理。 |
| 刘怡敏 | 国富强化收益债券基金和国富恒久信用债券基金的基金经理 | 2012年09月11日 | | 11年 | 刘怡敏女士,CFA,四川大学金融学硕士。历任西南证券研究发展中心债券研究员,富国基金管理有限公司从事债券投资及研究工作,国海富兰克林基金管理有限公司国富中国收益混合基金基金经理。截止本报告期末担任国海富兰克林基金管理有限公司国富强化收益债券基金和国富恒久信用债券基金的基金经理。 |

注:

1. 表中"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期,其中,首任基金经理的"任职日期"为基金合同生效日。

2. 表中"证券从业年限"的计算标准为该名员工从事过的所有诸如基金、证券、投资等相关金融领域的工作年限的总和。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规和《富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司在研究报告发布公平性、投资决策独立性、交易公平分配、信息隔离等方面均能严格执行《公平交易管理制度》,严格按照制度要求对异常交易进行控制和审批。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格按照《异常交易监控与报告制度》和《同日反向交易管理办法》对异常交易进行监控。报告期内公司不存在投资组合之间发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

央行2015年二季度继续保持以宽松的货币政策促进经济发展的思路,动用多种货币工具的同时进一步降低存款准备金和存贷款利率缓解了经济下行的压力,同时实体经济需求不振导致通货膨胀在低位徘徊也给与了央行进一步宽松的空间。虽然央行采用了多种货币政策刺激经济,但投资尤其是房地产市场可能很难像以前那样有爆发式的增长,而且资金进入实体经济需要的时间较长,同时欧洲经济的复苏之路有非常大的不确定性,导致我们的经济复苏在未来一到两个季度仍有非常大的不确定性。为了促使资金进入实体经济,央行也进行了一些尝试,但效果不是很明显,同时股市的上涨对资金也起了一定的分流。受短端利率下行的影响,企业债的收益率在二季度有一定下行,中债企业债总全价指数二季度总体上升了0.84%。国债收益率也有所下降,中债国债总全价指数上涨了1.24%。可转债在二季度受股市和溢价率降低的影响出现了前升后降的格局,上证转债指数总体下行了15.11%,表现大幅跑输股市。

本基金在二季度基本没有参与可转债的投资,同时降低了信用债的久期。

4.5 报告期内基金的业绩表现

国富恒久信用债券A 二季度净值上升了1.07%, 同期比较基准的收益率为1%, 基本跑平基准。国富恒久信用债券 C二季度净值上升了0.99%,同期比较基准的收益率 1%,基本跑平基准。本基金的上述业绩表现主要受益于基金在信用债上的配置。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### §5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | — | — |
| | 其中:股票 | — | — |
| 2 | 基金投资 | — | — |
| 3 | 固定收益投资 | 50,239,445.50 | 96.65 |
| | 其中:债券 | 50,239,445.50 | 96.65 |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 4 | 贵金属投资 | — | — |
| 5 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 6 | 买入返售金融资产 | — | — |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | — | — |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 709,224.92 | 1.36 |
| 8 | 其他资产 | 1,033,624.94 | 1.99 |
| 9 | 合计 | 51,982,295.36 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | — | — |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | 2,459,280.00 | 4.75 |
| | 其中:政策性金融债 | 2,459,280.00 | 4.75 |
| 4 | 企业债券 | 22,733,565.50 | 43.94 |
| 5 | 企业短期融资券 | 25,046,600.00 | 48.42 |
| 6 | 中期票据 | | — |
| 7 | 可转债 | — | — |
| 8 | 其他 | — | — |
| 9 | 合计 | 50,239,445.50 | 97.11 |

5.5 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债券投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 071536002 | 15华安证券CP002 | 80,000 | 8,016,000.00 | 15.50 |
| 2 | 071503004 | 15中信CP004 | 70,000 | 7,018,200.00 | 13.57 |
| 3 | 071525004 | 15国都证券CP004 | 70,000 | 7,011,200.00 | 13.55 |
| 4 | 122216 | 12桐昆债 | 32,000 | 3,253,760.00 | 6.29 |
| 5 | 071511005 | 15国信证券CP005 | 30,000 | 3,001,200.00 | 5.80 |

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1本基金本期投资的前十名证券中,报告期内发行主体被监管部门立案调查,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、处罚的情况说明如下:

国信证券股份有限公司(以下简称"国信证券")于2015年4月8日发布公告称,公司于2015年4月7日收到中国证券监督管理委员会2015年4月3日作出的《关于对国信证券股份有限公司采取责令增加内部合规检查次数措施的决定》,公司在开展融资融券业务中存在向在公司从事证券交易时间连续计算不足半年的客户融资融券等问题,情节较重,中国证券监督管理委员会对公司采取责令增加内部合规检查次数的行政监管措施。

本基金对15国信证券CP005投资决策说明:本公司的债券投研团队经过充分研究,认为该事件对国信证券的经营影响有限。本基金买入该债券的主要原因是看好其良好的股东背景、市场地位和盈利能力。本基金管理人对该债券的投资决策遵循公司的投资决策制度。

中信证券股份有限公司(以下简称"公司"或"中信证券")于2015年1月19日公告因存在为到期融资融券合约展期的问题(根据相关规定,融资融券合约期限最长为6个月),公司被中国证券监督管理委员会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。对此,公司已采取以下整改措施:

1、暂停新开立融资融券客户信用账户3个月。

2、自2015年1月16日起,公司将不允许新增任何新的合约逾期,距合约到期两周前将反复提醒客户及时了结合约,对于到期未了结的合约将强制平仓。

3、在监管规定的时间内,清理完成旧的逾期合约。

4、将融资融券业务客户开户条件由客户资产满人民币30万元提高到客户资产满人民币50万元。

本基金对15中信CP004投资决策说明:本公司的债券投研团队经过充分研究,认为该事件对中信证券的经营影响有限。本基金买入该债券的主要原因是看好其良好的股东背景、市场地位和盈利能力。本基金管理人对该债券的投资决策遵循公司的投资决策制度。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 7,392.61 |
| 2 | 应收证券清算款 | — |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 909,972.10 |
| 5 | 应收申购款 | 116,260.23 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 1,033,624.94 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期间的可转债。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | 国富恒久信用债券A类 | 国富恒久信用债券C类 |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 37,902,726.80 | 3,706,488.42 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,628,903.08 | 3,438,996.12 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 2,690,992.22 | 1,921,310.59 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | — | — |
| 报告期期末基金份额总额 | 36,840,637.66 | 5,224,173.95 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

| | 国富恒久信用债券A类 | 国富恒久信用债券C类 |
|---|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 6,730,050.93 | — |
| 报告期期间买入/申购总份额 | — | — |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | — | — |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 6,730,050.93 | — |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 18.27 | — |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内未有基金管理人运用固有资金投资本公司管理的该基金的情况。

### §8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金设立的文件;

2、《富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金基金合同》;

3、《富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金托管协议》;

5、中国证监会要求的其他文件。

8.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所并登载于基金管理人网站: www.ftsfund.com。

8.3 查阅方式

1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅,并可按工本费购买复印件。

2、登陆基金管理人网站www.ftsfund.com 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司
二〇一五年七月二十一日