（上接B22版）

客户服务电话:400-876-9988
公司网址:www.zscffund.com
53) 海银基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号4楼
法定代表人:刘惠
联系人:毛林
电话:021-80133597
传真:021-80133413
客户服务电话:400-808-1016
公司网址: www.fundhaiyin.com
54) 上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号4楼
法定代表人:胡学勤
联系人:宁博宇
电话:021-20665952
传真:021-50783597
客户服务电话:400-821-9031
公司网址:www.lufunds.com
55) 深圳新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址: 深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704
办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层
法定代表人:马勇
联系人: 文雯
电话:010-83363101
传真:010-83363072
客服电话: 4001661188
公司网址: www.jrj.com.cn
56) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:杭州市文二西路1号903室
办公地址:杭州市余杭区同顺街18号同花顺大楼4楼
法定代表人:凌顺平
联系人:费超超
电话:0571-88911818-8654
传真:0571-86800423
客户服务电话:4008-773-772
公司网址:www.5ifund.com
57) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址: 北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院
法定代表人: 江卉
联系人: 徐伯宇
电话: 4000988511/ 4000888816
传真: 010-89188000
客户服务电话: 95118
公司网址:fund.jd.com
58) 武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址: 湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城(一期)第七幢23层1号4号
办公地址:湖北省武汉市江汉区淮海路中央商务区泛海国际SOHO城2301室
法定代表人: 陶捷
联系人:徐博
电话:027-83863772
传真:027-83862682
客户服务电话:400-027-9899
公司网址:www.buyfunds.cn
59) 泰诚财富基金销售(大连)有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
联系人:孙先帅
电话:0411-88891212
传真:0411-88891212
客户服务电话:400-6411-999
公司网址: www.taichengcaifu.com
60) 奕丰金融服务 (深圳)有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115、1116、1307室
法定代表人:TAN YIK KUAN
联系人:叶健
电话:0755-8946 0500
传真:0755-21674453
客户服务电话:400-684-6500、400-684-0500
公司网址:www.ifastps.com.cn
61) 大泰金石投资管理有限公司
注册地址:南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
办公地址:上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15层
法定代表人:袁顾明
电话: 021-20324159
传真:021-20324199
联系人:赵明
客户服务电话:4009282266
公司网址:www.dtfunds.com
62) 北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址:北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
法定代表人:蒋煜
联系人: 蒋宸
电话:010-58170708
传真:010-5817 0800
客户服务电话:400 818 8866
公司网址:fund.shengshiview.com
63) 上海景谷资产管理有限公司
注册地址:浦东新区泥城镇新城路2号24幢N3809室
法定代表人:苏凯
联系人:沙海靖
电话:021-61621602
传真:021-61621602-819
客户服务电话:021-61621602
公司网址:www.g-fund.com.cn
64) 上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
法定代表人:王翔
联系人:张巍婧
电话:021-65370077-255
传真:021-55085991
客户服务电话:021-65370077
公司网址:www.jiyufund.com.cn
65) 一路财富(北京)信息科技股份有限公司
注册地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人:吴雪秀
电话:010-88312877
传真:+86(10)88312099
联系人:徐越
客户服务电话:4000011566
公司网址: www.yilucaifu.com
66) 平安证券股份有限公司
注册地址:深圳福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号平安金融大厦26层
法定代表人:曹实凡
电话:021-38631117
传真:021-58991896
联系人: 石静武
客户服务电话:95511-8
公司网址:stock.pingan.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—5511
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
注册地址: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
机构名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址: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:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
经办注册会计师:单峰、潘晓怡
联系人:单峰、潘晓怡
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800

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2017年7月18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至2017年6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	154,698,354.16	10.30
	其中:股票	154,698,354.16	10.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,250,013,831.96	83.21
	其中:债券	1,115,813,859.36	74.27
	资产支持证券	134,199,972.60	8.93
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	40,962,400.00	2.73
	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	7,643,214.28	0.51
8	其他资产	48,993,828.43	3.26
9	合计	1,502,311,628.83	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	38,679,791.28	2.97
C	制造业	73,589,591.68	5.66
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	29,333,094.40	2.25
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	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
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	13,095,876.80	1.01
	合计	154,698,354.16	11.89

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	600865	百大集团	2,498,560	29,333,094.40	2.25
2	601699	潞安环能	2,934,300	22,946,226.00	1.76
3	002444	巨星科技	1,052,512	16,398,136.96	1.26
4	000937	冀中能源	2,570,844	15,733,565.28	1.21
5	600875	东方电气	1,442,136	13,815,662.88	1.06
6	600777	新潮能源	3,428,240	13,095,876.80	1.01
7	600803	新奥股份	935,400	12,852,396.00	0.99
8	002048	宁波华翔	346,883	7,235,979.38	0.56
9	600073	上海梅林	713,851	6,817,277.05	0.52
10	600089	特变电工	627,927	6,486,485.91	0.50

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	62,269,021.50	4.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	65,402,222.70	5.03
	其中:政策性金融债	65,402,222.70	5.03
4	企业债券	670,015,188.66	51.49
5	企业短期融资券	125,303,500.00	9.63
6	中期票据	172,951,000.00	13.29
7	可转债	19,872,926.50	1.53
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,115,813,859.36	85.76

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	170210	17国开10	600,000	59,250,000.00	4.55
2	101651039	16牧原MTN001	550,000	53,999,000.00	4.15
3	136211	16恒力01	499,990	49,444,011.10	3.80
4	019557	17国债03	461,660	45,985,952.60	3.53
5	122422	15梅花01	460,000	45,797,600.00	3.52

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	1689284	16德宝天元2A2	700,000	50,162,000.00	3.86
2	142379	借呗06A1	400,000	40,000,000.00	3.07
3	142376	借呗05A1	150,000	15,000,000.00	1.15
4	123612	吉林水务03	110,000	11,000,000.00	0.85
5	123589	禾燃气03	100,000	10,037,972.60	0.77
6	142422	花呗13A2	80,000	8,000,000.00	0.61

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,报告期内无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	101,636.07
2	应收证券清算款	21,881,014.81
3	应收股利	-
4	应收利息	27,009,814.64
5	应收申购款	1,362.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	48,993,828.43

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	110032	三一转债	1,183,248.00	0.09
2	128012	辉丰转债	895,400.80	0.07
3	110031	航信转债	146,884.80	0.01

5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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。

截至2017年6月30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12月31日	15.30%	0.44%	4.51%	0.12%	10.79%	0.32%
2016年1月1日 - 2016年12月31日	3.16%	0.17%	-1.80%	0.13%	4.96%	0.04%
2017年1月1日 - 2017年6月30日	1.28%	0.12%	-2.48%	0.11%	3.76%	0.01%
2008年10月24日 - 2017年6月30日	68.89%	0.24%	4.98%	0.11%	63.91%	0.13%

(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12月31日	15.08%	0.44%	4.51%	0.12%	10.57%	0.32%
2016年1月1日 - 2016年12月31日	2.94%	0.17%	-1.80%	0.13%	4.74%	0.04%
2017年1月1日 - 2017年6月30日	1.13%	0.12%	-2.48%	0.11%	3.61%	0.01%
2008年10月24日 - 2017年6月30日	60.85%	0.24%	2.51%	0.11%	58.34%	0.13%

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(2017年第2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)新增了董事长吴显玲女士的信息;

(2)新增了副董事长麦敬恩(Gregory E. McGowan)先生的信息;

(3)删去了副董事长吴显玲女士的信息;

(4)删去了董事长麦敬恩(Gregory E. McGowan)先生的信息;

(5)新增了董事梁葆玲(Linda Liang)女士的信息;

(6)删去了董事阮博文先生的信息;

(7)删去了董事胡德忠先生的信息;

(8)新增了董事陆晓隽先生的信息;

(9)新增了管理层董事林勇先生的信息;

(10)删去了管理层董事徐荔蓉先生的信息;

(11)新增了监事梁江波先生的信息;

(12)删去了监事谭志华先生的信息;

(13)新增了总经理林勇先生的信息;

(14)删去了总经理吴显玲女士的信息;

(15)更新了副总经理徐荔蓉先生的信息;

(16)更新了基金经理刘怡敏女士的信息;

(17)更新了投资决策委员会成员的信息。

(18)更新了“基金管理人的风险管理和内部控制制度”部分信息。

4、“基金托管人”一章更新了基金托管人部分信息。

5、“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:

更新了宁波银行股份有限公司、兴业证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、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、深圳众禄金融控股股份有限公司、北京展恒基金销售股份有限公司、和讯信息科技有限公司、海银基金销售有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、深圳新兰德证券投资咨询有限公司、奕丰金融服务(深圳)有限公司、大泰金石基金销售有限公司等销售机构的信息。

新增了浙江同花顺基金销售有限公司、北京肯特瑞财富投资管理有限公司、武汉市伯嘉基金销售有限公司、一路财富(北京)信息科技股份有限公司、平安证券股份有限公司的信息。

(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:

更新了宁波银行股份有限公司、兴业证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、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、深圳众禄金融控股股份有限公司、北京展恒基金销售股份有限公司、和讯信息科技有限公司、众升财富(北京)基金销售有限公司、海银基金销售有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、深圳新兰德证券投资咨询有限公司、奕丰金融服务(深圳)有限公司、大泰金石基金销售有限公司、上海基煜基金销售有限公司等销售机构的信息。

新增了浙江同花顺基金销售有限公司、北京肯特瑞财富投资管理有限公司、武汉市伯嘉基金销售有限公司、一路财富(北京)信息科技股份有限公司、平安证券股份有限公司的信息。

(3)更新了会计师事务所的信息。

6、在“基金份额的申购与赎回”一章中更新了申购与赎回场所信息。

7、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2017年6月30日。

8、在“基金的业绩”一章中,更新了基金合同生效以来至2017年6月30日的本基金投资业绩。

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
2017年12月7日

证券代码:002884　　证券简称:凌霄泵业　　公告编号:2017-61

广东凌霄泵业股份有限公司
关于召开2017年第二次临时股东大会的提示性公告

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

广东凌霄泵业股份有限公司(以下简称“公司”)第九届董事会第十一次会议于2017年11月22日召开,会议决议于2017年12月12日(星期二)召开2017年第二次临时股东大会,公司已于2017年11月24日在公司指定信息披露媒体及深圳证券交易所网站(http://www.szse.cn/)、巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)上披露了《关于召开2017年第二次临时股东大会的通知》(公告编号:2017-55)。现发布关于召开2017年第二次临时股东大会的提示性公告如下:

一、召开会议的基本情况

(一)股东大会届次:2017年第二次临时股东大会

(二)会议召集人:公司董事会

(三)会议召开的合法合规性:本次股东大会的召集程序符合有关法律、法规和规范性文件以及《公司章程》的要求。

(四)会议召开时间:

1、现场会议时间:2017年12月12日(星期二)下午14:30开始

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具体时间为:2017年12月12日上午9:30—11:30,下午13:00—15:00;通过深圳证券交易所互联网投票系统进行网络投票的具体时间为:2017年12月11日下午15:00至2017年12月12日下午15:00期间的任意时间。

(五)会议召开方式:本次股东大会采用现场表决与网络投票相结合的方式召开。

(六)会议的股权登记日:2017年12月4日(星期一)

(七)现场会议召开地点:阳春市春城镇春江大道117号公司会议室

(八)会议出席对象:

1、截至2017年12月4日下午收市时在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的本公司全体普通股股东。上述本公司全体股东均有权出席股东大会和行使表决权;可以以书面形式委托代理人出席会议和参加表决,该股东代理人不必是本公司股东;

2、本公司董事、监事及高级管理人员;

3、本公司聘请的见证律师;

4、公司董事会同意列席的相关人员。

二、会议审议事项

(一)议案名称

1、《关于公司及子公司使用闲置自有资金进行现金管理的议案》;

根据《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引(2015 年修订)》的要求,本次会议审议的议案将对中小投资者的表决进行单独计票并及时公开披露。中小投资者是指除单独或合计持有上市公司 5%以上股份的股东及公司董事、监事和高级管理人员以外的其他股东。

(二)议案披露情况

以上议案已经公司第九届董事会第十一次会议审议通过。具体内容详见2017年11月24日于公司指定信息披露媒体及深圳证券交易所网站(http://www.szse.cn/)、巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)进行披露的相关公告。

三、提案编码

表一:本次股东大会提案编码示例表:

提案编码	提案名称	备注 该列打勾的栏目可以投票
非累积投票提案		
1.00	《关于公司及子公司使用闲置自有资金进行现金管理的议案》	√

四、会议登记方法

(一)登记方式

1、非自然人股东由法定代表人(或负责人)出席的,凭营业执照复印件、持股证明、法定代表人(或负责人)身份证以及法定代表人(或负责人)资格证明;授权委托代理人出席的,凭营业执照复印件、持股证明、法定代表人(或负责人)授权委托书、法定代表人(或负责人)资格证明、法定代表人(或负责人)身份证复印件和本人身份证办理登记。

2、自然人股东凭本人身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明、股票账户卡和持股证明登记;授权委托代理人持本人有效身份证件、授权委托书和委托人的身份证复印件、股票账户卡复印件及持股证明办理登记。

3、异地股东可采用书面信函或传真的方式登记。

(二)登记时间:2017年12月11日上午9:00-12:00;下午14:00-17:00。采用信函或传真方式登记的须在2017年12月11日下午17:00之前送达或传真到公司。

(三)登记地点:阳春市春城镇春江大道117号公司董事会办公室,邮编:529600(如通过信函方式登记,信封上请注明“2017年第二次临时股东大会”字样)

五、参加网络投票的具体操作流程

在本次股东大会上, 股东可以通过深交所交易系统和互联网投票系统 (地址为 http://wltp.cninfo.com.cn)参加投票,网络投票的具体操作流程见附件1。

六、其他事项

(一)会议联系方式

联系人:刘子庚

联系部门:公司董事会办公室

联系电话:0662-7707236　　传真:0662-7707233

(二)会期半天,与会股东食宿和交通费用自理;

(三)出席会议的股东需出示登记手续中所列明的文件。

七、备查文件

1、提议召开本次股东大会的第九届董事会第十一次会议决议

2、第九届监事会第七次会议决议

特此公告。

附件1:参加网络投票的具体操作流程

附件2:授权委托书

广东凌霄泵业股份有限公司董事会
2017年12月6日

附件1:

参加网络投票的具体操作流程

一、网络投票的程序

1、普通股的投票代码与投票简称:投票代码为“362884”,投票简称为“凌霄投票”。

2、填报表决意见

本次股东大会议案均为非累计投票议案。对于非累积投票议案,填报表决意见,同意、反对、弃权;

3、股东对总议案进行投票,视为对除累积投票提案外的其他所有提案表达相同意见(本次会议不设总议案)。

股东对总议案与具体提案重复投票时,以第一次有效投票为准。如股东先对具体提案投票表决,再对总议案投票表决,则以已投票表决的具体提案的表决意见为准,其他未表决的提案以总议案的表决意见为准;如先对总议案投票表决,再对具体提案投票表决,则以总议案的表决意见为准。

二、通过深交所交易系统投票的程序

1、投票时间:2017年12月12日的交易时间,即上午9:30—11:30和下午13:00—15:00。

2、股东可以登录证券公司交易客户端通过交易系统投票。

三、通过深交所互联网投票系统投票的程序

1、互联网投票系统开始投票的时间为2017年12月11日(现场股东大会召开前一日)下午15:00,结束时间为2017年12月12日(现场股东大会结束当日)下午15:00。

2、股东通过互联网投票系统进行网络投票,需按照《深圳证券交易所投资者网络服务身份认证业务指引(2016年4月修订)》的规定办理身份认证,取得“深交所数字证书”或“深交所投资者服务密码”。具体的身份认证流程可 登录互联网投票系统http://wltp.cninfo.com.cn规则指引栏目查阅。

3、股东根据获取的服务密码或数字证书,可登录http://wltp.cninfo.com.cn在规定时间内通过深交所互联网投票系统进行投票。

附件2:

授权委托书

兹全权委托　　　　先生(女士)代表我单位(个人),出席广东凌霄泵业股份有限公司2017年第二次临时股东大会,并代表本人依照以下指示对下列提案投票。若委托人没有对表决权的形式方式做出具体指示,受托人可以按自己的意愿投票。

提案编码	提案名称	备注 该列打勾的栏目可以投票	同意	反对	弃权
非累积投票提案					
1.00	《关于公司及子公司使用闲置自有资金进行现金管理的议案》	√			

委托人姓名或名称(签章):
委托人身份证号/营业执照号:
委托人持股性质:
委托人持股数量:
委托人股东账号:
受托人签名:
受托人身份证号:
委托书有效期限:
委托日期: 年 月 日

附注:

1、各选项中,在“同意”、“反对”或“弃权”栏中用“√”选择一项,多选无效,不填表示弃权。

2、对于委托人未对上述议案作出具体指示,被委托人(有权□无权□)代 表本人进行表决。(注:请委托人在权限的选项处打“√”。若委托人未进行选择,则视为代理人无权代表委托人就该等议案进行表决。)。

3、《授权委托书》复印件或按以上格式自制均有效;法人股东委托须加盖公章,法定代表人需签字。

证券代码:002512　　证券简称:达华智能　　公告编号:2017-113

中山达华智能科技股份有限公司关于筹划非公开发行股票停牌公告

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。

中山达华智能科技股份有限公司(以下简称"公司")因经营发展需要,正在筹划非公开发行股票相关事项。鉴于该事项存在重大不确定性,为保证公平信息披露,保护广大投资者利益,避免造成股票价格异常波动,根据《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引》、《中小企业板信息披露业务备忘录第14号:上市公司停复牌业务》》等有关规定,经公司向深圳证券交易所申请,公司股票(股票简称:达华智能,股票代码:002512)于2017年12月6日(星期三)上午开市起停牌,预计停牌时间不超过10个交易日,待上述事项确定后,公司将尽快披露相关公告并申请股票复牌。

停牌期间,公司将根据事项进展情况,严格按照有关法律法规的规定和要求及时履行信息披露义务。

公司指定信息披露媒体为《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》和巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)。公司所有信息均以在上述指定媒体披露的信息为准,敬请广大投资者关注公司后续公告并注意投资风险。

特此公告。

中山达华智能科技股份有限公司
董事会
二〇一七年十二月六日

证券代码:600550　　证券简称:保变电气　　公告编号:临2017-115
债券代码:122083　　债券简称:11天威债

保定天威保变电气股份有限公司诉讼进展公告

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。

保变天威保变电气股份有限公司(以下简称"公司"或"本公司")于近日收到四川省新津县人民法院(以下简称"新津法院")(2016)川0132民初384号《民事判决书》,现将有关诉讼进展情况公告如下:

一、民事判决书基本情况

关于天威新津投资有限公司诉本公司、天威四川硅业有限责任公司、中国工商银行股份有限公司保定朝阳支行、第三人中国川海建设有限公司、第三人河北建设集团有限公司抵押权纠纷一案(有关本案情况详见2016年8月18日、2017年3月21日、8月22日披露的相关公告)已由新津法院审理终结,新津法院于2017年11月10日作出(2016)川0132民初384号《民事判决书》。

二、民事判决书主要内容

1、确认原告天威新津投资有限公司与被告中国工商银行股份有限公司保定朝阳支行签订的《最高额抵押合同》无效。

2、驳回原告天威新津投资有限公司其他诉讼请求。

三、本次公告的诉讼进展情况对公司的影响

公司本次公告的诉讼案件进展情况,对公司生产经营无重大影响。公司已依法向四川省成都市中级人民法院提起上诉。

公司将根据进展情况及时履行信息披露义务,敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

保定天威保变电气股份有限公司董事会
2017年12月6日

证券代码:603822　　股票简称:嘉澳环保　　编号:2017-108
债券代码:113502　　债券简称:嘉澳转债

浙江嘉澳环保科技股份有限公司关于变更首次公开发行部分募集资金投资项目设备的公告内容更正公告

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。

浙江嘉澳环保科技股份有限公司(以下简称"公司")于2017年12月5日在上交所网站、《上海证券报》和《证券时报》披露了《变更首次公开发行部分募集资金投资项目设备的公告》(编号:2017-106),现对公告内容更正如下:

更正前内容:

五、关于变更募集资金项目部分设备履行的程序及专项意见

公司于2017年12月4日召开了第四届董事会第五次会议和第四届监事会第四次会议,分别审议通过了《关于变更首次公开发行部分募集资金投资项目设备的议案》,本议案无需提交公司股东大会审议。

更正后的内容:

五、关于变更募集资金项目部分设备履行的程序及专项意见

公司于2017年12月4日召开了第四届董事会第五次会议和第四届监事会第四次会议,分别审议通过了《关于变更首次公开发行部分募集资金投资项目设备的议案》,本议案尚需提交股东大会审议,董事会将于近期提请召开股东大会审议该议案。

特此公告。

浙江嘉澳环保科技股份有限公司董事会
2017年12月7日

证券代码:603843　　证券简称:正平股份　　公告编号:2017-075

正平路桥建设股份有限公司
关于重大事项进展暨复牌的补充公告

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。

正平路桥建设股份有限公司(以下简称"公司")筹划重大收购事项,公司股票自2017年11月22日连续停牌,并将于2017年12月6日复牌。停牌期间,公司与贵州欣汇盛源房地产开发有限公司、贵州水利实业有限公司协商初步达成收购意向, 该事项属于与公司主营业务相关的收购。公司于2017年12月5日盘后披露了《正平路桥建设股份有限公司重大事项进展暨复牌的公告》(公告编号:2017-073),为了使投资者更加全面地了解本次拟收购事项,现将有关事项补充公告如下:

1、公司拟以现金方式通过购买股权或购买股权+增资方式持有贵州水利实业有限公司51%的股权。

2、贵州水利实业有限公司具有水利水电工程施工总承包壹级资质(建筑业企业资质证书编号:D152012420),详见住建部网站全国建筑市场监管公共服务平台(http://jzsc.mohurd.gov.cn/)。

特此公告。

正平路桥建设股份有限公司董事会
2017年12月6日

证券代码:603779　　证券简称:威龙股份　　公告编号:2017-086

威龙葡萄酒股份有限公司关于公司注册资本完成工商变更登记的公告

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。

根据威龙葡萄酒股份有限公司(以下简称"公司")2016年第二次临时股东大会决议,公司股东大会已授权董事会在有关法律法规和公司股东大会决议范围内全权办理本次非公开发行股票的相关事宜,根据本次实际非公开发行股票结果,增加公司注册资本/总股份数、修改公司章程相应条款及办理工商变更登记等相关事宜。鉴于公司非公开发行股票的结果,公司于2017年11月21日召开了第四届董事会第五次会议和第四届监事会第五次会议,审议通过了《关于修改公司章程的议案》(具体内容详见2017年11月22日在上海证券交易所网站披露的《关于修改公司章程的公告》编号为:2017-076)。

近日,公司完成了本次注册资本工商变更登记,并对《公司章程》进行了工商备案,现已取得烟台市工商行政管理局换发的《营业执照》。变更后,公司注册资本变更为229,646,720元人民币,其他工商登记信息不变。

特此公告。

威龙葡萄酒股份有限公司董事会
2017年12月7日

股票代码:600614 900907　　股票简称:鹏起科技 鹏起B股　　公告编号:临2017-094

鹏起科技发展股份有限公司关于公司股东股份质押的公告

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。

鹏起科技发展股份有限公司(以下简称"公司")于2017年12月6日接到股东曹亮发先生的通知,曹亮发先生将其持有的公司部分无限售流通股质押给方正证券股份有限公司(以下简称"方正证券"),股份质押具体情况如下:

一、股份质押情况

因业务开展需要,曹亮发先生于2017年12月5日将其持有的公司部分无限售流通股1,350万股质押给方正证券,质押期限为一年,质押手续于2017年12月5日办理完毕。

二、股份累计被质押情况

截至2017年12月6日,曹亮发先生共持有本公司无限售流通股股份143,403,324股,占公司总股本的8.18%。本次质押后,曹亮发先生累计质押股份127,920,000股,占曹亮发先生持有公司股份总数的89.20%,占公司总股本的7.30%。

特此公告

鹏起科技发展股份有限公司
2017年12月7日

报备文件:《历史成交情况表》