富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金更新招募说明书（摘要）

（2018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

富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金（以下简称“本基金“）经中国证监会证监许可[2012426号文核准，机构部函[2015]248号文确认，本基金的基金合同于2015年3月26日生效。

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。

本基金是股票指数增强型基金，属于高预期收益、高预期风险的证券投资品种，其预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。从本基金所分离出来的两类基金份额来看，国富中证100 A份额具有低风险、收益相对稳定的特征；国富中证100 B份额均有高风险、高预期收益的特征。

本基金份额初始面值1.00元，在市场波动等因素的影响下，基金份额净值可能低于基金份额初始面值。

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。投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、合规性风险、操作和技术风险、本基金的特定风险（如指数化投资风险、投资替代风险、跟踪偏离风险、杠杆机制风险、折/溢价交易风险、份额配对转换业务及基金份额折算等业务办理过程中的特有风险等）和投资股指期货的风险。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个开放日本基金份额的净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额) 超过上一日全部基金份额（分级运作期内包括国富中证100份额、国富中证100 A 份额和国富中证100 B份额）的10%时，投资者将可能无法及时赎回持有的全部国富中证100份额。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定），在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下，如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能预见的特殊情形下，可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击，发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负担。

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2018年9月26日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年6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
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：施颖楠
联系电话：021-3855 -5555

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

二、主要人员情况

（一）董事会成员：

董事长吴显玲女士，中共党员，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法定代表人、总经理，广西证券有限责任公司副总裁、国海证券有限责任公司副总裁、国海富兰克林基金管理有限公司督察长、董事长、国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事长、国海富兰克林基金管理有限公司副董事长兼总经理、国海富兰克林投资管理（上海）有限公司执行董事兼总经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司董事长，兼任国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事长、代为履行总经理职责。

副董事长麦敬恩（Gregory E. McGowan）先生，文学学士，硕士学位以及法学博士学位。在加入富兰克林邓普顿投资集团之前，麦敬恩先生是美国证券交易委员会的资深律师。麦敬恩先生于1986年加入富兰克林邓普顿投资集团，担任Templeton Worldwide Inc. 执行副总裁、董事和法律总顾问。曾任多个富兰克林邓普顿公司董事，包括但不限于Franklin Templeton Management Luxembourg S.A.（卢森堡），富兰克林邓普顿投资（亚洲）有限公司（香港），Templeton Asset Management Ltd.（新加坡），Franklin Templeton Holding Limited （毛里求斯），Franklin Templeton Services Limited（爱尔兰），国海富兰克林基金管理有限公司董事长，中国人寿富兰克林资产管理有限公司股东代表。现任富兰克林邓普顿投资集团高级战略顾问，Templeton International Inc.执行副总裁及法律总顾问，Franklin Templeton France S.A和Franklin Templeton Strategic Investments, Ltd. 董事，Templeton Investment Counsel, LLC执行副总裁，Franklin Templeton Investment Services Gmbh咨询委员会委员，Brinker Destinations Trust独立董事，国海富兰克林基金管理有限公司股东代表、副董事长，国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事，中国人寿富兰克林资产管理有限公司董事，国寿富兰克林（深圳）股权投资基金管理有限公司董事，Global Capital Plc.独立董事。

董事何春梅女士，中共党员，工程硕士。历任广西壮族自治区政府办公厅第五秘书处科员、副主任科员，广西开发投资有限责任公司融资部副经理、财务部副经理、经理、总经理，广西投资集团有限公司总裁助理兼办公室主任，国海证券有限责任公司监事，广西壮族自治区金融工作办公室副主任、党组成员、机关党委书记，广西北部湾股权交易所股份有限公司董事长。现任广西投资集团有限公司党委副书记，国海证券股份有限公司党委书记、董事长，国海良时期货有限公司董事，国海创新资本投资管理有限公司董事，国海富兰克林基金管理有限公司董事。

董事梁葆玲（Linda Liang）女士，CPA，加利福尼亚执照，经济学文学学士。历任毕马威会计师事务所加利福尼亚旧金山办事处税务监督高级专员，安永会计师事务所加利福尼亚圣何塞和帕洛阿尔托办事处税务顾问高级经理。梁葆玲女士于2005年加入富兰克林邓普顿投资集团，历任富兰克林邓普顿投资总部美国公司税及全球税总监，富兰克林邓普顿资本控股私人有限公司（新加坡）亚洲规划与策略总监。现任邓普顿资产管理有限公司首席行政官，国海富兰克林基金管理有限公司董事，国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事。

董事燕文波先生，中共党员，工商管理硕士。历任君安证券有限责任公司人力资源部职员、资产管理部职员，上海浦东科创有限公司投资部经理，民生证券有限责任公司人力资源部总经理，联合证券有限责任公司人力资源部总经理、机构客户部总经理，国海证券有限责任公司总裁助理（并先后兼任总裁办公室主任和资产管理部、资本市场部、北京管理总部总经理等职务），副总裁兼北京分公司总经理，国海证券有限责任公司副总裁兼北京分公司总经理。现任国海证券股份有限公司副总裁兼企业金融服务委员会主任及深圳分公司总经理，国海富兰克林基金管理有限公司董事，国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事。

董事陆晓隽先生，工商管理硕士。历任上海市徐汇区旅游局科员，上海PSD管理咨询公司顾问、项目经理，华信惠悦咨询公司顾问、高级顾问、咨询经理、咨询总监，韬睿惠悦咨询（上海）有限公司全球数据业务中国区副总经理暨首席顾问、资本市场中国区总经理、人力资本业务中国区总经理暨首席顾问、中国区金融业董事总经理。现任国海证券股份有限公司人力资源总监兼首席战略官、研究所所长、战略管理部总经理，国海富兰克林基金管理有限公司董事。

董事张伟先生，硕士研究生学历。历任澳纽银行集团（悉尼）企业银行主任，香港上海汇丰银行国际信托有限公司副总裁，银行家信托有限公司（英国）联席董事，德意志信托（香港）有限公司董事。2000年7月加入富兰克林邓普顿投资，先后担任机构业务拓展董事、香港区销售及市场业务拓展主管、香港区总监。现任富兰克林邓普顿投资（亚洲）有限公司大中华区总监及董事，国海富兰克林基金管理有限公司董事。

独立董事张忠国先生，中共党员，硕士研究生学历，高级会计师。历任广西柳州地区财政局副局长，广西鹿寨县人民政府副县长，柳州地区行署副秘书长、财办主任，广西财政厅预算处处长，广西财政厅总会计师、副厅长（享受正厅级待遇），现已退休。现任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，三亚财经论坛发展有限公司董事。现任国海富兰克林基金管理有限公司独立董事。

独立董事刘戎戎女士，MBA商学硕士。历任麦肯锡公司商业分析员，昆仲亚洲基金合伙人，Vision Investment Management(Asia) Limited董事总经理，博信资本业务合伙人。现任得仕股份有限公司董事及副总经理，联新国际医疗集团投资管理委员会首席顾问，国海富兰克林基金管理有限公司独立董事。

独立董事施宇澄先生，工商管理硕士，为奥迈资本管理有限公司创办人兼管理合伙人。施先生曾经担任中国人寿资产管理有限公司独立董事及中国人寿富兰克林资产管理（香港）公司独立董事，现任中国人寿资产管理公司另类投资咨询委员会成员，笔克远东控股公司（香港联交所主板上市公司）独立董事，国海富兰克林基金管理有限公司独立董事，以及上海发展研究基金会理事及兼职研究员。

管理层董事林勇先生，工商管理硕士。历任江西省人民银行调查统计处调查分析员，江西省资金融通中心融资部交易员，招商银行总行计划资金部资金交易中心经理，嘉实基金管理有限公司投资管理部基金经理，国泰基金管理有限公司固定收益部总监助理、基金经理，平安银行股份有限公司资金交易部总经理、金融市场事业部副总裁兼资产管理中心、投资交易中心总经理，资产管理事业部副总裁，平安磐海资本有限公司董事长兼总经理，平安证券股份有限公司资产管理事业部总经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司总经理、管理层董事。

（二）监事会成员

监事会主席余天丽女士，经济学学士。历任富达基金（香港）有限公司投资服务代表，Asiabondportal.com营销助理，富达基金（香港）有限公司亚洲区项目经理，英国保诚资产管理（新加坡）有限公司亚洲区战略及产品发展部副董事，瑞士信贷资产管理（新加坡）有限公司亚洲区产品发展部总监，工银瑞信基金管理有限公司专户投资部产品负责人。现任富兰克林邓普顿资本控股有限公司（富兰克林邓普顿投资集团全资子公司）亚洲区产品策略部董事，国海富兰克林基金管理有限公司监事会主席。

监事梁江波先生，研究生班学历，中共党员，经济师、会计师。历任广西信托投资公司计划财务部核算一科副科长，太平洋保险公司（寿险）南宁分公司财务部会计，国海证券有限责任公司计划财务部会计核算部经理，国海良时期货有限公司财务总监兼财务部总经理，国海证券股份有限公司财务管理部副总经理（主持工作）。现任国海证券股份有限公司财务管理部总经理、国海富兰克林基金管理有限公司监事。

职工监事张志强先生，CFA，纽约州立大学（布法罗）计算机科学硕士，中国科学技术大学数学专业硕士。历任美国Enreach Technology Inc.软件工程师，海通证券股份有限公司研究所高级研究员，友邦华泰基金管理有限公司高级数量分析师，国海富兰克林基金管理有限公司首席数量分析师、风险控制部总经理、业务发展部总经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司量化与指数投资总监、金融工程部总经理、国富沪深300指数增强基金和国富中证100指数增强分级基金基金经理、职工监事。

职工监事赵晓东先生，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、国富弹性市值混合基金和国富潜力组合混合基金的基金经理助理，国富沪深300指数增强基金基金经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司权益投资总监、QDII投资总监、国富中小盘股票基金、国富焦点驱动混合基金、国富弹性市值混合基金和国富恒瑞债券基金基金经理，职工监事。

（三）经营管理层人员

总经理林勇先生，工商管理硕士。历任江西省人民银行调查统计处调查分析员，江西省资金融通中心融资部交易员，招商银行总行计划资金部资金交易中心经理，嘉实基金管理有限公司投资管理部基金经理，国泰基金管理有限公司固定收益部总监助理、基金经理，平安银行股份有限公司资金交易部总经理、金融市场事业部副总裁兼资产管理中心、投资交易中心总经理、资产管理事业部副总裁，平安磐海资本有限公司董事长兼总经理，平安证券股份有限公司资产管理事业部总经理。现任国海富兰克林基金管理有限公司总经理，管理层董事。

副总经理徐荔蓉先生，CFA，CPA（非执业），律师（非执业），中央财经大学经济学硕士。历任中国技术进出口总公司金融部副总经理，融通基金管理有限公司基金经理，申万巴黎基金管理有限公司（现“申万菱信基金管理有限公司”）基金经理，国海富兰克林基金管理有限公司高级顾问、资产管理部总经理兼投资经理、管理层董事。现任国海富兰克林基金管理有限公司副总经理、投资总监、研究分析部总经理，国富中国收益混合基金、国富潜力组合混合基金和国富研究精选混合基金基金经理。

副总经理王雷先生，硕士研究生。历任华东计算技术研究所技术安全部职员，平安证券有限责任公司成都及上海地区营业部总经理、南京北门桥路证券营业部总经理，经纪业务事业部执行总经理，招商基金管理有限公司华东机构理财中心副总监、机构理财部负责人。现任国海富兰克林基金管理有限公司副总经理。

副总经理胡昕彦女士，工商管理硕士。历任中国银行上海市分行会计科科员，汇丰数据处理（上海）有限公司共同基金部高级专员，2004年加入国海富兰克林基金管理有限公司，先后担任基金事务部副总经理、行政管理部副总经理、行政管理部总经理、总经理助理。现任国海富兰克林基金管理有限公司副总经理。

（四）督察长

督察长储丽莉女士，中共党员，律师（非执业），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顾问、投资经营部副总经理，李宁体育（上海）有限公司法律顾问。2005年加入国海富兰克林基金管理有限公司，先后担任公司法律顾问、高级法律顾问、监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理、管理层董事、国海富兰克林资产管理（上海）有限公司董事会秘书。自2006年起，还同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、高级法律顾问。

（五）基金经理

现任基金经理

张志强先生，CFA，纽约州立大学（布法罗）计算机科学硕士，中国科学技术大学数学专业硕士。历任美国Enreach Technology Inc.软件工程师，海通证券股份有限公司研究所高级研究员，友邦华泰基金管理有限公司高级数量分析师，国海富兰克林基金管理有限公司首席数量分析师、风险控制部总经理、业务发展部总经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司量化与指数投资总监、金融工程部总经理、职工监事、国富沪深300指数增强基金及国富中证100指数增强分级基金的基金经理。

历任基金经理

2016年5月至2017年9月由鲍翔先生担任本基金基金经理，与现任基金经理张志强先生共同管理本基金。

（六）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：林勇先生（公司总经理）；徐荔蓉先生（公司副总经理、投资总监、研究分析部总经理、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、职工监事）；赵晓东先生（权益投资总监、QDII投资总监、基金经理、职工监事）；刘怡敏女士（固定收益投资总监、基金经理）；叶斐先生（风险控制部总经理助理）。

储丽莉女士（督察长）有权列席投资决策委员会的任何会议。

（七）上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）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
注册资本：
人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人：陈四清
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号
托管部门信息披露联系人：王永民
传真：（010）66594942
中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2018年6月30日，中国银行已托管674只证券投资基金，其中境内基金638只，QDII基金36只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于 “SAS70”、“AAF01/06” “ISAE3402” 和 “SSAE16” 等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017年，中国银行继续获得了基于 “ISAE3402” 和 “SSAE16” 双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

（五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人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，及时通知基金管理人，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，应当及时通知基金管理人，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

（一）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
联系人：王蓉婕
联系电话：021-3855 5678
传真：021-6887 0708

（二）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
办公地址：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
公司网站：www.boc.cn

（2）中国农业银行股份有限公司
注册地址：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：周慕冰
客户服务电话：95599
公司网址：www.abchina.com

（3）招商银行股份有限公司
注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
办公地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：李建红
电话：0755-83077278
传真：0755-83195050
联系人：邓炯鹏
客户服务电话：95555
公司网址：www.cmbchina.com

（4）交通银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路188号
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：牛锡明
电话：021-58781234
传真：021-58408483
联系人：曹榕
客户服务电话：95559
公司网址：www.bankcomm.com

（5）上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市中山东一路12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：唐苑
客户服务电话：95528
公司网址：www.spdb.com.cn

（6）财富证券有限责任公司
注册地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层
办公地址：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：蔡一兵
电话：0731-84403319
传真：0731-84403439
联系人：郭静
客户服务电话：400-88-35316
公司网址：www.cfzq.com

（7）东北证券股份有限公司
注册地址：长春市生态大街6666号办公地址：长春市生态大街6666号法定代表人：李福春
电话：0431-85096517
联系人：安岩岩
客户服务电话：95360公司网址：www.nesc.cn

（8）国海证券股份有限公司
注册地址：广西桂林市辅星路13号
办公地址：广西南宁市滨湖路46号国海大厦
法定代表人：何春梅
电话：0755—83709350
传真：0755—83704850
联系人：牛孟宇
客户服务电话：95563
公司网站：www.ghzq.com.cn

（9）国泰君安证券股份有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：杨德红
电话：021-38676666
传真：021-38670666
联系人：朱雅崴
客户服务电话：400-8888-666/95521
公司网址：www.gtja.com

（10）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市广东路689号海通证券大厦
办公地址：上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人：王开国
电话：021-23219000
传真：021-23219100
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
公司网址：www.htsec.com

（11）中泰证券股份有限公司
注册地址：山东省济南市经七路86号
办公地址：山东省济南市经七路86号
法定代表人：李玮
电话：021-20315290
传真：0531-68889095联系人：许曼华客户服务电话：95538
公司网址：www.zts.com.cn

（12）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
办公地址：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
电话：0351-8686659
传真：0351-8686619
联系人：张慧斌
客户服务电话：400-666-1618、95573
公司网址：www.i618.com.cn

（13）申万宏源证券有限公司
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人：李梅
电话：021-33389888
传真：021-33388224
联系人：黄莹
客户服务电话：95523、4008895523
公司网址：www.swhysc.com

（14）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
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
电话：010-66045608
传真：010-66045152
联系人：李昱平
客户服务电话：010-66045678
公司网址：www.txsec.com
天相基金网网站：www.jjm.com.cn

（15）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：上海市浦东新区长柳路36号
法定代表人：杨华辉
电话：021-38565547
联系人：乔琳雪
客户服务电话：95562
公司网址：www.xyzq.com.cn

（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
办公地址：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：陈有安
电话：010-66568450
传真：010-66568990
联系人：邓颜
客户服务电话：400-888-8888
公司网址：www.chinastock.com.cn

（17）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
办公地址：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：0755-83734343
联系人：林生迎
客户服务电话：95565
公司网址：www.newone.com.cn

（18）中信建投证券股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市东城区朝内大街188号
法定代表人：王常青
电话：010-85130588
传真：010-65182261
联系人：权唐
客户服务电话：95587
公司网址：www.csc108.com

（19）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
办公地址：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：0755-82558305
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

（20）中航证券有限公司
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
办公地址：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3207室
法定代表人：王宜四
电话：0791-86768681
传真：0791-86770178
联系人：戴蕾
客户服务电话：400-8866-567
公司网址：www.avicsec.com

（21）上海证券有限责任公司
注册地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼
办公地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼
法定代表人：李俊杰
电话：021-53686888
传真：021-53686100-7008，021-53686200-7008
联系人：邵珍珍
客户服务电话：021-962518
公司网址：www.962518.com

（22）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

（23）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：赵俊
电话：021-20333333
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

（24）中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦
法定代表人：王东明
电话：010-60838696
传真：010-60833739
联系人：顾凌
客户服务电话：95548
公司网址：www.cs.ecitic.com

（25）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：0451-85863719
传真：0451-82287211
联系人：刘爽
客户服务电话：400-666-2288
公司网址：www.jhzq.com.cn

（26）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：021-68778790
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

（27）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

（28）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

（29）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：海市黄浦区南京西路399号明天广场20楼
法定代表人：陈灿辉
电话：021-63898427
传真：021-68776977-8427
联系人：徐璐
客户服务电话：400-820-5999
公司网址：www.shhxzq.com

（30）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：孙秋月
客户服务电话：95548
公司网址：www.citicssd.com

（31）中信期货有限公司
注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人：张皓
电话：0755-23953913
传真：0755-83217421
联系人：洪诚
公司网站：www.citicsf.com
客服电话：400-990-8826

（32）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：周驰
客户服务电话：95511-8
公司网址：stock.pingan.com

（33）西南证券股份有限公司
注册地址：重庆市江北区桥北苑8号
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人：吴坚
电话：023-63786633
传真：023-63786212
联系人：张煜
客户服务电话：95355 、4008096096
公司网址： www.swsc.com.cn

（34）南京证券股份有限公司
注册地址：江苏省南京市大钟亭8号
办公地址：江苏省南京市大钟亭8号
法定代表人：步国旬
电话：025-52310550
传真： 025-52310586
联系人：王万君
客户服务电话：95386
公司网址：www.njzq.com.cn

（35）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：上海市徐汇区宛平南路88号26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

（36）蚂蚁（杭州）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：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法定代表人：陈柏青
联系人：韩爱彬
电话：0571-26888888
传真：0571-26697013
客户服务电话：4000-766-123
公司网址：www.fund123.cn

（37）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：王诗玙
电话：021-20613643
传真：021-68596916
客户服务电话：400-700-9665
公司网址： www.ehowbuy.com

（38）诺亚正行（上海）基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号C栋2楼
法定代表人：汪静波
联系人：余翼飞
电话：021-80358749
传真：021-38509777
客户服务电话：400-821-5399
公司网址：www.noah-fund.com

（39）深圳众禄基金销售股份有限公司
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8号HALO广场4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

（40）北京展恒基金销售股份有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦6楼
法定代表人：闫振杰
联系人：李晓芳
电话：010-59601366-7167
传真：0351-4110714
客户服务电话：4008188000
公司网址：www.myfund.com

（41）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1002室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22 号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
联系人：刘洋
电话：010-85650628
传真：021-65884788
客户服务电话：400-920-0022
公司网址：licaike.hexun.com

（42）众升财富(北京)基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室
办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08
法定代表人：李招弟
联系人：李艳
电话：010-59497361
传真：010-64788016
客户服务电话：400-059-8888
公司网址：www.zscffund.com

（43）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
办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人：张跃伟
联系人：常艳琴
电话：021-20691832
客户服务电话：400-820-2899
公司网址：www.erichfund.com

（44） 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

（45）上海陆金所基金销售有限公司
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：王之光
联系人：宁博宇
电话：021-20665952
传真：021-22066653
客户服务电话：400-821-9031
公司网址：www.lufunds.com

（46）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

（47）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

（48）北京肯特瑞基金销售有限公司
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
联系人：韩锦星
电话：13810801527
客户服务电话：95118
公司网址：fund.jd.com

（49）武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址：武汉市江汉区台北一路17-19号环亚大厦B座601室
办公地址：武汉市江汉区台北一路17-19号环亚大厦B座601室
法定代表人： 陶捷
联系人：陆锋
电话：027-83863742
传真：027-83862682
客户服务电话：400-027-9899
公司网址：www.buyfunds.cn

（50）上海联泰资产管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8 座3层
法定代表人： 燕斌
联系人：兰敏
电话：021-52822063
传真：021-52975270
客户服务电话：400-166-6788
公司网址：www.66zichan.com

（51）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

（52）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

（53）奕丰基金销售有限公司
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道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人：TEO WEE HOWE
联系人：叶健
电话：0755-89460500
传真：0755-21674453
客户服务电话： 400-684-0500
公司网址：www.ifastps.com.cn

（54）大泰金石基金销售有限公司
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： 021-20324155
传真：021-20324199
联系人：赵明
客户服务电话：4009282266
公司网址：www.dtfunds.com

（55）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

二、注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号
法定代表人：周明
办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号
联系人：陈文祥
联系电话：021-68419095
传真：021-68870311

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海通力律师事务所
注册地址： 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层
负责人：俞卫锋
联系人：黎明
经办律师： 吕红、黎明
联系电话：021- 31358666
传真：021- 31358600

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：潘晓怡
联系电话：（021）23238888
传真：（021）23238800

四、基金名称

富兰克林国海中证100指数增强型证券投资基金

五、基金的类型

股票指数增强型基金

六、基金的投资目标

通过量化风险管理方法，控制基金投资组合与标的指数构成的偏差，同时采取适当的增强策略，在严格控制跟踪误差风险的基础上，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，追求基金资产的长期增值。在正常市场情况下，本基金力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。

七、基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。如果法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产净值的比例为90%－95%，其中投资于股票资产的比例不低于基金资产净值的90%，投资于中证100指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产净值的80%；债券、现金以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为5%-10%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

八、基金的投资策略

本基金基于被动复制的指数化投资方法，在严格控制跟踪误差风险的基础上，适度运用资产配置调整、行业配置调整、指数成份股权重优化等主动增强策略，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。

1、资产配置策略

本基金采取指数增强策略。为控制基金的跟踪误差风险，本基金的资产配置将保持与业绩比较基准基本一致，只在股票、债券（主要是国债）、现金等各大类资产间进行小幅度的主动调整，追求适度超越业绩比较基准的收益目标。

本基金在投资范围内进行资产配置小幅主动调整的主要投资决策依据是对于国家宏观经济形势、财政货币政策、资产估值水平、市场投资者情绪等因素及其对于股票市场、债券市场的影响的分析和判断。此外，在实际投资管理过程中，由于受市场价格波动、市场流动性限制、基金份额申购赎回等因素的影响，基金的资产配置比例也可能发生小幅波动，基金经理将对此进行密切监控，必要时进行及时调整。

2、股票投资策略

为严格控制跟踪误差风险，本基金的股票投资以被动复制跟踪标的指数为主，辅以适度的增强策略。

（1）指数复制策略

① 定期调整

本基金将根据中证 100指数成份股及其权重的定期调整，及时对股票投资组合进行相应调整，以控制投资组合与标的指数构成的偏离，从而实现对跟踪误差风险的控制。

② 不定期调整

根据指数编制规则，当中证 100指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据中证指数有限公司发布的临时调整方案，及时对股票投资组合进行相应调整，以控制投资组合与标的指数构成的偏离，从而实现对跟踪误差风险的控制。

③ 特殊情形下的调整

如有标的指数成份股由于停牌、市场流动性、法律法规等原因的限制，导致基金管理人无法依照标的指数权重买入该成份股时，基金管理人将从上市公司的行业归属、上市公司的基本面特征、股票风格特征、股票价格收益率的相关性、市场流动性等方面进行综合评估，寻找合适的替代股票进行投资。选择替代股票将遵循以下原则：

替代股票优先从标的指数成份股及备选成份股中挑选，如不能在标的指数成份股及备选成份股中挑选出较合适的替代股票，再考虑从非指数成份股中选择；

替代股票的上市公司应与被替代股票上市公司属于同一行业，经营业务相似度较高；

替代股票应与被替代股票的市值规模等风格特征差异较小；

替代股票或股票组合与被替代股票在考察期内收益率序列的相关度较高，二者表现出类似的风险收益特征；

替代股票应具有较好的市场流动性；

进行股票替代后，被替代成份股所在行业在基金股票资产组合中的权重应与标的指数中该行业权重基本一致；

如在同行业中无法找到替代股票或者同行业的替代股票无法配置到应有权重，本基金将通过优化方法选择其他替代股票或股票组合，以控制股票组合的跟踪偏离和跟踪误差风险。

（2）增强策略

本基金在指数化投资的基础上进行适度增强的主要依据是国内股票市场的非完全有效性和指数编制及其调整方法的局限性。本基金将在严格控制跟踪误差风险的基础上，采取调整股票仓位、行业配置、个股权重等方法力求获取超越业绩比较基准的投资收益。

① 股票仓位调整

当结合对国家宏观经济形势、财政货币政策、资产估值水平、市场投资者情绪等因素的综合分析，比较明确地判断市场将经历一段较长时间的下跌过程时，本基金将在基金合同约定的投资范围内下调股票投资仓位，以适度规避股票市场的系统性风险。

② 行业配置调整

通过比较不同行业的景气周期、盈利增长、相对估值和市场价格变化特征，在严格控制基金组合跟踪偏离和跟踪误差的基础上，适度超配具有较高投资价值的行业，低配投资吸引力较低的行业，以获取超越业绩比较基准的投资收益。

③ 个股权重调整

本基金基于对个股的深入研究，结合量化风险管理方法，在严格控制投资组合跟踪偏离和跟踪误差的基础上，适度调整个股在股票投资组合中的配置比例。通过比较同一行业内不同上市公司的行业地位、核心竞争力、成长性、估值水平、市场价格变化特征等因素，判断个股的投资价值，适度超配投资价值较高的个股、低配投资价值较低的个股，优化投资组合的收益风险特征，力求实现超越业绩比较基准的投资收益。

本基金将剔除或者低配具备以下特征的标的指数成份股：

上市公司基本面恶化，经营业绩严重下滑；

股价涨幅已严重透支其现有业绩或未来成长性的股票；

本基金将定期评估标的指数成份股的市场流动性，剔除或者低配流动性较差的个股；

存在其他严重负面因素的成份股。例如发生严重生产事故的上市公司个股、面临重大不利行政处罚或司法诉讼的上市公司个股、市场价格被操纵的个股等。

④ 其它辅助增强策略

本基金将在控制投资风险和跟踪误差风险的前提下，适度运用其它增强策略，力求获取超越标的指数的投资收益：

分析指数调整期间的调入调出个股的市场价格特征，在控制跟踪误差风险的前提下，有针对性地选择基金组合调整时机，以获取超额收益；

选择替代股票时，考查替代股票的投资价值。在满足作为替代股票的标准的前提下，选择具备较高投资价值的个股；

适当参与新股发行、增发或配股在内的具有良好投资机会的股票，增强基金的投资收益；

运用股指期货等工具管理基金投资组合的股票仓位和现金头寸，避免由于应对频繁申购赎回产生交易费用，降低基金的管理成本。

3、债券投资策略

本基金债券投资的主要目的是在保证基金资产流动性的前提下，提高基金资产的投资收益。本基金主要投资于信用等级高、流动性好的政府债券、金融债、企业债等。

本基金在进行债券组合管理中，将基于对国内外宏观经济形势、国家财政货币政策动向、市场资金流动性等方面的分析，对利率、信用利差变化的趋势进行判断，综合考察债券的投资价值和流动性等因素，构建和调整债券投资组合。

4、股指期货投资策略

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则参与股指期货交易，以提高投资管理效率，降低跟踪误差风险。

本基金参与股指期货交易，将采用流动性好、交易活跃的合约，以高效调整股票仓位。此外，在预期大额申购赎回、大额分红等情形发生时，本基金可以通过参与股指期货交易进行有效的现金头寸管理，同时达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金参与股指期货交易，将严格遵循有关法律法规要求，遵循本基金管理人制定的相关投资决策流程和风险控制制度，事前将交易方案提交本基金管理人的股指期货投资决策小组审核通过，在股指期货投资决策小组核定的范围内进行。

九、基金的业绩比较基准

1、标的指数

本基金股票资产的标的指数为中证100指数。

中证 100指数是从沪深 300指数样本股中挑选规模最大的 100只股票组成样本股，以综合反映沪深证券市场中最具市场影响力的一批大市值公司的整体状况。中证 100指数具有市场代表性好、历史业绩表现突出、编制规则透明度高、流动性强、市场认知程度高、指数运作体系完备等综合优势。

如果中证 100指数被停止编制及发布，或中证 100指数由其他指数替代（单纯更名除外），或由于指数编制方法等重大变更导致中证 100指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上出现其他代表性更强、更合适投资的指数作为

本基金的标的指数，本基金管理人可以依据审慎性原则，在充分考虑持有人利益的前提下，履行适当程序后，更换本基金的标的指数和投资对象；并依据市场代表性、流动性、与原指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数。

本基金由于上述原因变更标的指数和投资对象，需履行适当程序，并在正式实施前在至少一种中国证监会指定的媒体上予以公告。

2、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准：中证100指数收益率*95%+银行同业存款利率*5%

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更业绩比较基准并及时公告。

本基金由于上述原因变更标的指数和业绩比较基准，基金管理人应在调整前3个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票指数增强型基金，属于高预期收益、高预期风险的证券投资品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

在本基金分级运作期内，从本基金所分离出来的两类基金份额来看，由于基金收益分配的安排，国富中证100 A份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征；国富中证100 B份额则表现出高风险、收益相对较高的特征。

十一、基金的投资组合报告

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2018年7月18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。

本投资组合报告所载数据截止至2018年6月30 日，本报告中财务资料未经审计。

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	54,140,897.53	91.64
	其中：股票	54,140,897.53	91.64
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	4,389,355.54	7.43
8	其他资产	550,985.28	0.93
9	合计	59,081,238.35	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末（指数投资）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	1,831,967.00	3.15
C	制造业	19,452,130.16	33.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,697,860.88	2.92
E	建筑业	2,064,973.40	3.55
F	批发和零售业	616,202.88	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	1,419,783.00	2.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,013,509.60	1.74
J	金融业	22,685,734.45	38.95
K	房地产业	2,611,166.60	4.48
L	租赁和商务服务业	400,102.56	0.69
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	53,793,430.53	92.36

2.2 报告期末（积极投资）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	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,000.00	0.02
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	-	-
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	338,467.00	0.58
S	综合	-	-
	合计	347,467.00	0.60

2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金未通过港股通交易机制投资港股。

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

3.1 期末指数投资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	85,300	4,996,874.00	8.58
2	600519	贵州茅台	3,977	2,909,016.42	4.99
3	000651	格力电器	44,300	2,088,745.00	3.59
4	600036	招商银行	73,100	1,932,764.00	3.32
5	601166	兴业银行	118,100	1,700,640.00	2.92
6	600016	民生银行	223,300	1,563,100.00	2.68
7	000333	美的集团	29,600	1,545,712.00	2.65
8	600276	恒瑞医药	17,681	1,339,512.56	2.30
9	601288	农业银行	361,200	1,242,528.00	2.13
10	000858	五 粮 液	14,921	1,133,996.00	1.95

3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002739	万达电影	8,900	338,467.00	0.58
2	603693	江苏新能	1,000	9,000.00	0.02

4. 报告期末按券种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. 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。

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。

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序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

9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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

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、处罚的证券如下：

招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）于2018年5月4日收到中国银行保险监督管理委员会（以下简称“中国银保监会”）出具的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银监罚决字〔2018〕1号）》，就招商银行主要违法违规事实公告如下：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。

中国银保监会对招商银行做出如下行政处罚：没收违法所得人民币3.024万元，处以罚款人民币6,570万元，罚没合计人民币6,573.024万元。

本基金对招商银行投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究，认为上述事件仅对招商银行短期经营有一定影响，不改变长期投资价值。同时由于本基金看好银行的长期发展前景，因此买入招商银行。本基金管理人对该股的投资决策遵循公司的投资决策制度。

兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）于2018年5月4日收到中国银行保险监督管理委员会（以下简称“中国银保监会”）出具的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监银罚决字〔2018〕1号）》，就兴业银行主要违法违规事实公告如下：（一）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；（二）非真实转让信贷资产；（三）无授信额度或超授信额度办理同业业务；（四）内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；（五）同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；（六）债券卖出回购业务违规出表；（七）个人理财资金违规投资；（八）提供日期倒签的材料；（九）部分非现场监管统计数据与事实不符；（十）个别董事未经任职资格核准即履职；（十一）变相批量转让个人贷款；（十二）向四证不全的房地产项目提供融资。

中国银保监会处以罚款人民币5,870万元。

本基金对兴业银行投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究，认为上述事件仅对兴业银行短期经营有一定影响，不改变长期投资价值。同时由于本基金看好银行整体的长期发展前景，因此买入兴业银行。本基金管理人对该股的投资决策遵循公司的投资决策制度。

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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	23,838.32
2	应收证券清算款	483,801.47
3	应收股利	-
4	应收利息	786.22
5	应收申购款	42,559.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	550,985.28

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的可转债。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.5.1报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

11.5.2报告期末积极投资前五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	002739	万达电影	338,467.00	0.58	重大资产重组停牌
2	603693	江苏新能	9,000.00	0.02	新股未上市

十二、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2018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：

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
2015年3月26日— 2015年12月31日	-11.70%	2.49%	-5.06%	2.44%	-6.64%	0.05%
2016年1月1日-2016年12月31日	-5.30%	1.25%	-7.01%	1.19%	1.71%	0.06%
2017年1月1日-2017年12月31日	34.22%	0.66%	28.58%	0.65%	5.64%	0.01%
2018年1月1日-2018年6月30日	-10.36%	1.17%	-11.16%	1.16%	0.80%	0.01%
2015年3月26日-2018年6月30日	0.61%	1.51%	0.85%	1.48%	-0.24%	0.03%

十三、基金的费用概述

一、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、基金合同生效后的信息披露费用；
4、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
5、基金合同生效以后的信息披露费用；
6、基金份额持有人大会费用；
7、基金合同生效以后的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
8、基金所用证券账户的开户费用及银行账户的维护费；
9、基金上市初费和上市月费；
10、基金资产的资金汇划费用；
11、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、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

在分级运作期内，基金管理人的基金管理费按基金财产净值的1.0%年费率计提。在分级运作期届满后，基金的基金管理费调整为按前一日基金资产净值的0.85%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金财产净值的1.0%年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times$年管理费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金财产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

在分级运作期内，基金托管费按基金财产净值的0.22%年费率计提。在分级运作期届满后，基金托管费调整为按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times$年托管费率÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金财产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法计提指数许可使用费。指数许可使用费分为许可使用固定费和许可使用基点费。基金合同生效前的指数许可使用费是许可使用固定费，是为获取使用指数开发基金的权利而支付的费用，不列入基金费用，不从基金财产中列支；基金合同生效后的指数许可使用费是指数许可使用基点费，计费时间从基金合同生效日开始计算。基金设立当年，不足一个季度的，按照一个季度收费。指数许可使用基点费的收取下限为每季人民币伍万元（5万元）（即不足人民币5万元时按照人民币5万元收取）。指数许可使用基点费从基金财产中列支，按前一日基金资产净值的 0.016%的年费率每日计提，逐日累计。计算方法如下：

$H=E\times0.016\%\div$当年天数

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

指数许可使用基点费的支付方式为每季度一次，自基金合同生效日起，基金管理人应于每年1月、4月、7月、10月的最后一个工作日前，按照双方确认的金额向中证指数有限公司支付上一季度的指数许可使用基点费。

如果指数许可使用费的计算方法和费率等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应及时按照《信息披露管理办法》的规定在指定媒体进行公告。此项调整无需召开基金份额持有人大会。

4、除管理费、托管费和标的指数许可使用费之外的基金费用，由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、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；
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3、基金合同生效前的相关费用；
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

五、税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

1、“重要提示”一章中更新了本基金风险收益特征，本招募说明书（更新）所载内容截止日为2018年9月26日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日（财务数据未经审计）。

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）更新了董事何春梅女士的信息；
（3）更新了董事陆晓隽先生的信息；
（4）更新了独立董事徐同女士的信息；
（5）更新了独立董事施宇澄先生的信息；

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）更新了以下代销机构的信息：诺亚正行（上海）基金销售有限公司、北京展恒基金销售股份有限公司、和讯信息科技有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、北京肯特瑞基金销售有限公司、武汉市伯嘉基金销售有限公司、奕丰基金销售有限公司等代销机构的相关信息。

5、在“基金的投资”一章中，更新了本基金的风险收益特征以及本基金最近一期投资组合的内容，内容更新到2018年6月30日。

6、在“基金的业绩”一章中，更新了基金合同生效以来至2018年6月30日的本基金投资业绩。

7、“风险揭示”一章中更新了本基金的风险收益特征。

8、更新了“其他应披露的事项”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
2018年11月9日