

**富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金**  
**金**  
**2010 年年度报告（摘要）**  
**2010 年 12 月 31 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：二〇一一年三月二十六日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2011 年 3 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在年度报告正文中对相关事项有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	国富沪深 300 指数增强
基金主代码	450008
交易代码	450008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 9 月 3 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
报告期末基金份额总额	1, 151, 469, 617. 89 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金采用指数增强投资策略。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，同时结合主动投资方法，在严格控制跟踪偏离风险的基础上，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，本基金对业绩比较基准的年跟踪误差不超过 8%。</p>
投资策略	<p>资产配置策略： 本基金以追求基金资产长期增长的稳定收益为宗旨，在股票市场上进行指数化被动投资的基础上，基金管理人在债券（国债为主）、股票、现金等各类资产之间仅进行适度的主动配置。通过运用深入的基本面分析及先进的数量技术，控制与目标指数的跟踪误差，追求适度超越目标指数的收益。</p> <p>股票投资策略： 本基金以指数化投资为主，以最小化跟踪误差为组合的投资控制目标，本基金所跟踪的目标指数为沪深 300 指数。</p> <p>本产品指数化投资的基础上辅以有限度的增强操作（优化调整）及一级市场股票投资。具体而言，基金将基本依据目标指数的成份股构成权重，并借助数量化投资分析技术构造和调整指数化投资组合。在投资组合建立后，基金定期对比检验组合与比较基准的偏离程度，适时对投资组合进</p>

	<p>行调整，使指数优化组合与目标指数的跟踪误差控制在限定的范围内。在正常市场情况下，本基金对业绩比较基准的年跟踪误差不超过 8%。此外，本基金将利用所持有股票市值参与一级市场股票投资，以在不增加额外风险的前提下提高收益水平，争取获得超过指数的回报。</p> <p>债券投资策略： 本基金将在对宏观经济和资本市场进行研究的基础上，对利率结构、市场利率走势进行分析和预测，综合考虑中债国债指数各成份券种及金融债的收益率水平、流动性的好坏等因素，进行优化选择构建本基金的债券投资组合。</p> <p>本基金以富兰克林邓普顿集团固定收益类资产投资研究平台及本基金管理人的投资研究平台为依托，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。</p>
业绩比较基准	95% × 沪深 300 指数 + 5% × 银行同业存款利率
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，属于较高风险、较高预期收益的证券投资基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国海富兰克林基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡定超
	联系电话	021-3855 5555
	电子邮箱	service@ftsfund.com
客户服务电话	021-38789555、400-700-4518 和9510-5680	95599
传真	021-6888 0981	010-6320 1816

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海湖滨路202号普华永道中心11楼

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年	2009 年 9 月 3 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	98,329,193.11	133,932,805.55
本期利润	-105,398,451.96	370,162,771.34
加权平均基金份额本期利润	-0.0682	0.1636
本期基金份额净值增长率	-5.89%	15.50%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末
期末可供分配基金份额利润	0.087	0.063
期末基金资产净值	1,251,081,095.65	2,039,900,498.04
期末基金份额净值	1.087	1.155

注：1. 本基金合同生效日为 2009 年 9 月 3 日(基金合同生效日)，因此没有 2008 年的对比数据。

2. 上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则一第 1 号《主要财务指标的计算及披露》。

3. 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。

4. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

5. 上述基金业绩指标不包括持有人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要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	7.62%	1.60%	6.28%	1.68%	1.34%	-0.08%
过去六个月	24.51%	1.42%	20.95%	1.47%	3.56%	-0.05%
过去一年	-5.89%	1.46%	-11.77%	1.50%	5.88%	-0.04%
自基金合同生效起至今	8.70%	1.46%	8.06%	1.57%	0.64%	-0.11%

注：根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金的业绩比较基准=沪深 300 指数×95% + 同业存款利率×5%。本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深 300 指数，具有较强的代表性。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1 日收益率（ $Benchmark_t$ ）按下列公式计算：

$$Benchmark_t = 95\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{沪深 300 指数}_{t-1}) + 5\% \times \text{同业存款利率} / 360$$

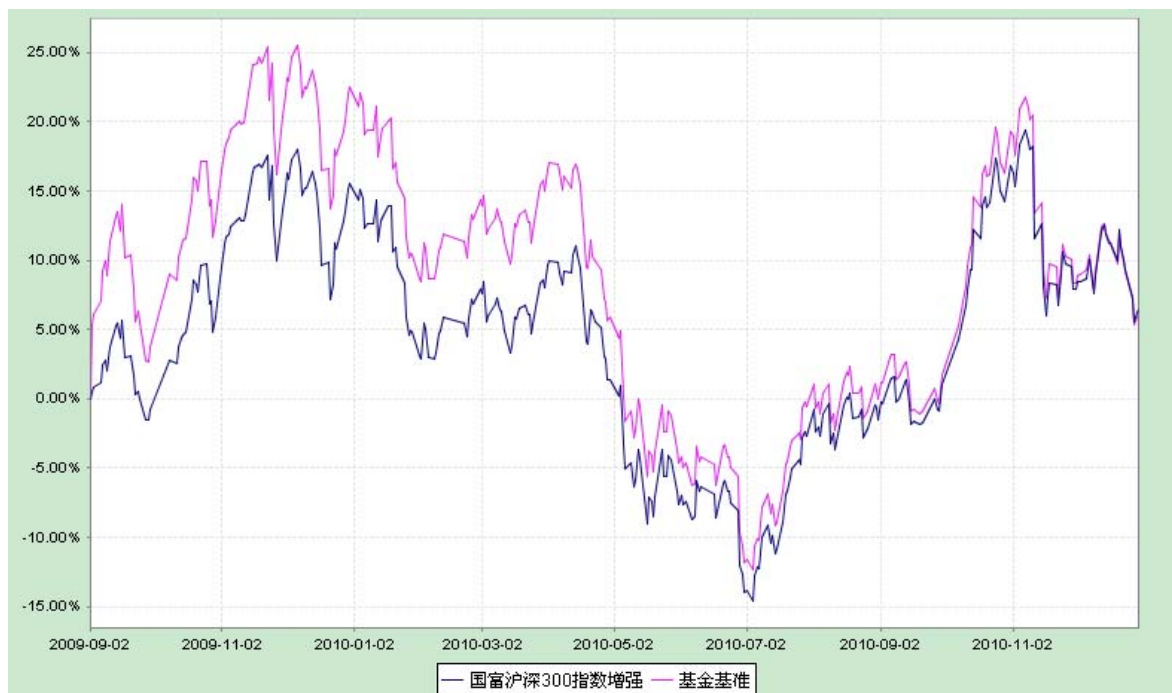
其中， $t=1,2,3,\dots,T$ ， $T$  表示时间截止日。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金

份额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 9 月 3 日至 2010 年 12 月 31 日）



注：1、本基金的基金合同生效日为 2009 年 9 月 3 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。

2、根据本基金合同，本基金投资组合的范围为“股票资产占基金资产的比例为 85%–95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%，现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%–15%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证占基金资产净值的比例不高于 3%”。

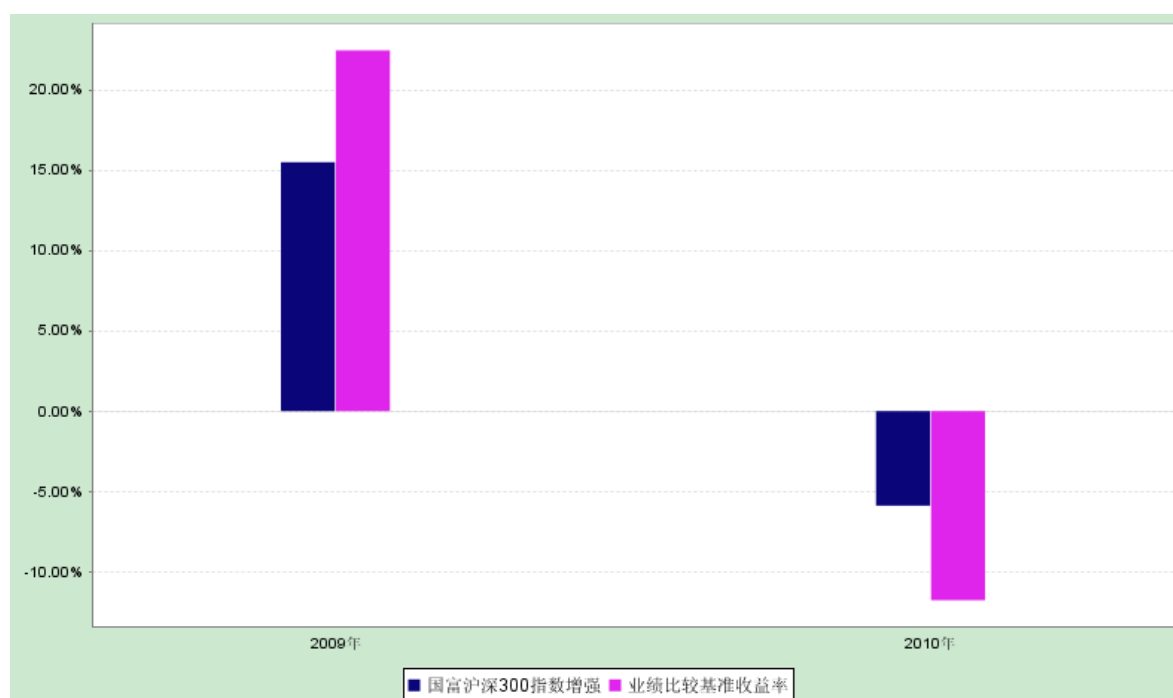
“因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金不符合上述规定或者基金合同约定的投资组合限制的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。”

3、本基金本报告期遵守法律、法规和基金合同的比例限制进行证券投资。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金

自基金合同生效以来每年净值增长率图



注：1、本基金成立于 2009 年 9 月 3 日，故 2009 年的业绩为成立日至年底的业绩而非全年的业绩；

2、根据基金合同，本基金的资产配置比例范围为：股票 85%—95%，债券和现金类资产 5%—15%；

3、本基金的业绩比较基准 = 95%×沪深 300 指数+5%×同业存款利率。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010	0	0	0	0	-
2009	0	0	0	0	-
2008	-	-	-	-	-
合计	0	0	0	0	-

注：本基金于 2009 年 9 月 3 日基金合同生效。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国海富兰克林基金管理有限公司成立于 2004 年 11 月，由国海证券有限责任公司和富兰克林邓普顿投资集团全资子公司邓普顿国际股份有限公司共同出资组建，注册资本为人民币壹亿元。2005 年底，经中国证监会批准，股东出资在现有股东之间进行了转让，转让后国海证券有限责任公司出资比例为 51%，邓普顿国际股份有限公司为 49%，公司注册资本保持不变。2006 年 8 月，经公司股东会 2006 年第二次临时会议决议，公司的注册资本由人民币壹亿元增加至人民币壹亿伍仟万元。该项增资扩股申请已于 2006 年 11 月获中国证监会批准，增资后双方股东出资比例保持不变，相关工商注册变更手续已于 2007 年 1 月初办理完毕并公告。2007 年 12 月，经国海富兰克林基金管理有限公司股东会审议通过，国海富兰克林基金管理有限公司的注册资本由人民币壹亿伍仟万元增加为人民币贰亿贰仟万元，增资后原股东持股比例保持不变，已经中国证券监督管理委员会批准，相关工商注册变更登记手续已完成。

我公司具有丰富的管理基金经验，从 2005 年 6 月第一只基金成立到现在，已经成功管理了 8 只基金产品（包含 A、C 类债券基金）。8 只基金业绩优秀，丰富优秀的基金管理能力也获得多方权威机构好评。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵晓东	本基金基金经理	2009-09-03	-	7 年	赵晓东先生，香港大学 MBA、辽宁工程技术大学经济学学士。曾任淄博矿业集团项目经理、浙江证券分析师、上海交大高新技术股份有限公司高级投资经理，国海富兰克林基金管理有限公司高级研究员，弹性市值基金经理助理和潜力组合基金经理助理。从事煤炭、机械、汽车、交通运输



					和 IT 等行业的研究工作。现任富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金与富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：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合规守信情况的说明

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《富兰克林国海沪深 300 指数增强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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内公司严格执行《公平交易管理制度》，明确了公平交易的原则和目标，制订了实现公平交易的具体措施，并在技术上按照公平交易原则实现了严格的交易公平分配。报告期内不存在基金间通过价差交易进行利益输送的行为。

##### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

报告期末，公司共管理了八只基金，即富兰克林国海中国收益证券投资基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金、富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金、富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金和富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金，其中富兰克林国海中国收益证券投资基金为混合型基金，富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金为债券型基金，其余六只基金为股票型基金。公司已开展特定客户资产管理业务，共管理了四只产品，即“农行国富成长一号”、“光大国富互惠一号”、“中行国富配置一号”和“兴业国富互惠一号”。公司尚未开展企业年金、社保基金资产管理业务。报告期内未发生公司管理的投资风格相似的不同基金之间的业绩表现差异超过 5% 的情况。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司按照《异常交易监控与报告制度》，系统划分了异常交易的类型、异常交易的界定标准、异常交易的识别程序，制订了异常交易的监控办法，并规范了异常交易的分析、报告制度。

报告期内未发生法规严格禁止的同一基金或不同基金之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010 年度，国内的证券 A 股市场总体呈现先抑后扬的震荡格局，沪深 300 指数下跌 12.51%。2010 年，由于受到 2010 年信贷超常规释放的影响和政府加快经济增长方式转变的政策推动影响，市场的结构发生了巨大变化，尤其是对房地产的严厉调控，通货膨胀持续快速走高，市场对货币紧缩预期对银行等金融行业估值形成较大压制。中小盘股票和新兴产业，消费医药等行业股票全年持续走强，传统行业地产和银行金融等表现大幅落后，如果指数中提出银行和地产，钢铁等少数行业，整个市场走出了单边上涨的趋势；同时，海外市场受到美国和欧洲经济复苏低于预期，以及美国数量宽松，欧债危机等影响，对国内的市场也形成了一定的压力。

2010 年，本基金始终维持高仓位，在主动操作上，选择了行业和个股的增强为主，在行业和个股的选择上，坚持基本面和自下而上的选股策略，积极配置成长股票，尤其大消费行业，特别是零售，家电和服饰，新兴产业等行业，取得不错的超额收益。被动操作继续采用抽样分层的数量方式策略。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2010 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.087 元，本报告期份额净值下跌为 5.89%，同期业绩基准下跌为 11.77%，超越业绩基准 5.88 个百分点。本基金本报告期累计年化跟踪误差为 2.56%，在合同规定的年化跟踪误差范围之内。通过适度的增强，四季度基金实现了超越业绩基准的目标。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2011 年度，我们认为，去年的中央经济会议已经为 2011 年的经济做出基本指导，预计国内经济继续维持平稳的增长势头，特别是消费增长继续保持较快速度，经济转型继续深化。在投资上，保障房将成为 2011 年投资增长的亮点，高铁和中西部区域规划也会成为投资增长的主要动力；进出口方面，进出口增速预计平稳回落，但预计仍然保持 10% 左右的增长。总体上看，

宏观经济层面继续向好，2011 年保持 GDP 保持 8% 以上的增长把握性较大；但通货膨胀会维持较高水平，货币政策收紧概率较大。流动性方面，虽然银行贷款有所回落，但人民币升值在仍然会对资本流入形成较好的吸引力，总体来看，上半年受到货币紧缩与其影响，市场难有表现，维持震荡概率较高；下半年经济速度放缓，货币政策可能放松，市场估值可能有所恢复。基于 2011 年沪深 300 指数整体估值不高，我们看好保障房和农村消费受益的家电等消费行业，同时择机估值合理时介入增长确定的零售和医药行业，同时积极挖掘新型产业等行业与个股增长机会，适当介入通胀题材，重点通过行业和个股增强，争取获得超额受益。

本基金将继续按照基金合同及相关法律法规要求，努力做好基金投资工作，争取未来更好的长期投资收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司在报告期内有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定设有投资资产估值委员会（简称“估值委员会”），并修订了《公允估值管理办法》。估值委员会审核和决定投资资产估值的相关事务，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会主席为总经理（或其任命者）；投票成员：主席，投资总监，营运总监，风险管理经理，基金会计经理，监察稽核部负责人，法务主管；非投票成员（观察员，列席表达相关意见）：督察长，基金经理，交易室负责人。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期间没有进行利润分配。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金的过程中，本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定以及《富兰克林国海沪深

300 指数增强型证券投资基金基金合同》、《富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》的约定，对富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金管理人—国海富兰克林基金管理有限公司 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，国海富兰克林基金管理有限公司在富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，国海富兰克林基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

经普华永道中天会计师事务所审计，注册会计师为本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
-----	-----	--------------------	---------------------

<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	68,122,333.71	129,276,680.47
结算备付金		405,238.44	2,218,766.57
存出保证金		520,262.84	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,182,762,072.59	1,937,944,112.79
其中：股票投资		1,182,762,072.59	1,937,923,512.79
基金投资		-	-
债券投资		-	20,600.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,143,592.05	151,798.94
应收利息	7.4.7.5	13,727.67	29,957.44
应收股利		-	-
应收申购款		492,640.56	11,701,232.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,255,459,867.86	2,081,322,549.16
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2010年12月31日</b>	<b>上年度末 2009年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,786,042.21	37,411,485.36
应付管理人报酬		946,456.19	1,521,132.02
应付托管费		167,021.67	268,435.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	944,068.67	1,831,049.09
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	535,183.47	389,949.58

负债合计		4,378,772.21	41,422,051.12
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,151,469,617.89	1,766,336,321.55
未分配利润	7.4.7.10	99,611,477.76	273,564,176.49
所有者权益合计		1,251,081,095.65	2,039,900,498.04
负债和所有者权益总计		1,255,459,867.86	2,081,322,549.16

注：1. 本基金报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.087 元，基金份额总额 1,151,469,617.89 份。

2. 后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

## 7.2 利润表

会计主体：富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年9月3日（基金合同生 效日）至2009年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>-82,546,881.90</b>	<b>385,430,462.56</b>
1. 利息收入		815,978.48	1,007,338.63
其中：存款利息收入	7.4.7.11	809,799.05	1,004,362.14
债券利息收入		650.35	2,976.49
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,529.08	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		118,128,540.56	146,460,571.75
其中：股票投资收益	7.4.7.12	102,807,052.47	144,145,981.65
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益		372,479.95	1,717,490.69
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	14,949,008.14	597,099.41
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-203,727,645.07	236,229,965.79
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,236,244.13	1,732,586.39

<b>减：二、费用</b>		<b>22,851,570.06</b>	<b>15,267,691.22</b>
1. 管理人报酬		13,575,199.69	6,811,672.31
2. 托管费		2,395,623.40	1,202,059.84
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	6,186,022.70	6,873,620.09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	694,724.27	380,338.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-105,398,451.96</b>	<b>370,162,771.34</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-105,398,451.96</b>	<b>370,162,771.34</b>

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,766,336,321.55	273,564,176.49	2,039,900,498.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-105,398,451.96	-105,398,451.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-614,866,703.66	-68,554,246.77	-683,420,950.43
其中：1. 基金申购款	1,243,321,180.21	98,912,704.13	1,342,233,884.34
2. 基金赎回款	-1,858,187,883.87	-167,466,950.90	-2,025,654,834.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,151,469,617.89	99,611,477.76	1,251,081,095.65
项目	上年度可比期间 2009年9月3日（基金合同生效日）至2009年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,423,832,173.19	-	2,423,832,173.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	370,162,771.34	370,162,771.34
三、本期基金份额交易产生的基金净	-657,495,851.64	-96,598,594.85	-754,094,446.49

值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	279,386,826.46	36,271,152.24	315,657,978.70
2. 基金赎回款	-936,882,678.10	-132,869,747.09	-1,069,752,425.19
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,766,336,321.55	273,564,176.49	2,039,900,498.04

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

本报告从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：金哲非，主管会计工作负责人：董卫军，会计机构负责人：王雅芳

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第 652 号《关于核准富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金募集的批复》，由国海富兰克林基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,423,482,243.08 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 153 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2009 年 9 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,423,832,173.19 份基金份额，其中认购资金利息折合 349,930.11 份基金份额。本基金的基金管理人为国海富兰克林基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的范围为：股票资产占基金资产的比例为 85%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%，现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-15%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证占基金资产净值的比例不高于 3%。本基金除投资于目标指数的成份股票，包括沪深 300 指数的成份股和备选成份股以外，还可适当投资一级市场申购的股票(包括新股与增发)，以在不增加额外风险的前提下提高收



益水平。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$  沪深 300 指数 $+5\% \times$  同业存款利率。

本财务报表由本基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司于 2011 年 3 月 25 日批准报出。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会基金部通知[2010]5 号关于发布《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》等问题的通知、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金根据 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2009 年 9 月 3 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

###### **(i) 金融资产的分类**

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金

融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (ii) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(ii) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(iii) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也

可按直线法计算。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 外币交易**

无。

#### **7.4.4.13 分部报告**

无。

#### **7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收

益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金采用的行业指数为中证协(SAC)基金行业股票估值指数。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

无。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，2008 年 9 月 16 日之前按停牌前最后交易日的收盘价估值；根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金自 2008 年 9 月 16 日起采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金自 2010 年 4 月 20 日起，采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

无。

#### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(d) 自 2008 年 9 月 19 日起基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
活期存款	68,122,333.71	129,276,680.47
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	68,122,333.71	129,276,680.47

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,150,259,751.87	1,182,762,072.59	32,502,320.72
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,150,259,751.87	1,182,762,072.59	32,502,320.72
项目	上年度末 2009 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,701,693,547.00	1,937,923,512.79	236,229,965.79
债券	交易所市场	20,600.00	20,600.00
	银行间市场	-	-

	合计	20,600.00	20,600.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	1,701,714,147.00	1,937,944,112.79	236,229,965.79

注：截至 2010 年 12 月 31 日，本基金未在银行间同业市场进行过债券交易。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

截至报告期末，本基金没有持有衍生金融资产项目。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

截至报告期末，本基金持有的买入返售金融资产余额为零。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应收活期存款利息	13,585.87	29,141.90
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	141.80	776.60
应收债券利息	-	38.94
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	13,727.67	29,957.44

#### 7.4.7.6 其他资产

截至报告期末，本基金持有的其他资产余额为零。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
交易所市场应付交易费用	944,068.67	1,831,049.09
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	944,068.67	1,831,049.09

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	4,996.72	140,997.18
信息披露费	370,000.00	50,000.00
审计费	100,000.00	100,000.00
应付指数使用费	60,186.75	98,952.40
合计	535,183.47	389,949.58

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,766,336,321.55	1,766,336,321.55
本期申购	1,243,321,180.21	1,243,321,180.21
本期赎回（以“-”号填列）	-1,858,187,883.87	-1,858,187,883.87
本期末	1,151,469,617.89	1,151,469,617.89

注：上表中申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**7.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	110,716,408.83	162,847,767.66	273,564,176.49
本期利润	98,329,193.11	-203,727,645.07	-105,398,451.96
本期基金份额交易产生的变动数	-59,794,150.90	-8,760,095.87	-68,554,246.77
其中：基金申购款	111,794,924.26	-12,882,220.13	98,912,704.13
基金赎回款	-171,589,075.16	4,122,124.26	-167,466,950.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	149,251,451.04	-49,639,973.28	99,611,477.76

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年9月3日（基金合同生效日）至2009年12月31日
活期存款利息收入	783,800.60	977,858.89
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	18,382.65	26,458.12



其他	7,615.80	45.13
合计	809,799.05	1,004,362.14

**7.4.7.12 股票投资收益****7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年9月3日（基金合同生效日）至2009年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	102,807,052.47	144,145,981.65
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	102,807,052.47	144,145,981.65

**7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年9月3日（基金合同生效日）至2009年12月31日
卖出股票成交总额	2,251,845,766.56	1,731,548,397.73
减：卖出股票成本总额	2,149,038,714.09	1,587,402,416.08
买卖股票差价收入	102,807,052.47	144,145,981.65

**7.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年9月3日（基金合同生效日）至2009年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,479,469.24	8,010,228.24
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,106,300.00	6,289,800.00
减：应收利息总额	689.29	2,937.55
债券投资收益	372,479.95	1,717,490.69

**7.4.7.14 衍生工具收益****7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

报告期内本基金衍生工具收益为零。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年9月3日（基金合同生效日）至2009年12月31日
股票投资产生的股利收益	14,949,008.14	597,099.41
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	14,949,008.14	597,099.41

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年9月3日（基金合同生效日）至2009年12月31日
1. 交易性金融资产	-203,727,645.07	236,229,965.79
——股票投资	-203,727,645.07	236,229,965.79
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-203,727,645.07	236,229,965.79

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年9月3日（基金合同生效日）至2009年12月31日
基金赎回费收入	2,172,564.11	1,336,669.65
转换费收入	63,680.02	544.20
基金合同生效前银行存款利息收入	-	48,483.58
其他	-	346,888.96
合计	2,236,244.13	1,732,586.39

注：(a) 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

(b) 本基金的转换费由申购费补差和转出基金的赎回费组成，其中转出赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年9月3日（基金合同生效日）至200
----	-----------------------------	-----------------------------------

		9年12月31日
交易所市场交易费用	6,186,022.70	6,873,620.09
银行间市场交易费用	-	-
合计	6,186,022.70	6,873,620.09

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年9月3日（基金合同生效日）至 2009年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	320,000.00	150,000.00
债券帐户维护费	18,000.00	-
其他手续费	240.00	-
银行汇划费用	951.20	2,119.23
指数使用费	255,533.07	128,219.75
合计	694,724.27	380,338.98

注：根据《富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》及《中证指数公司指数使用许可协议》，基金的指数许可使用费从基金财产中列支，在通常情况下，指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.016% 的年费率计提，逐日累计至每季最后一日，按季支付。计算方法如下：

日指数使用费 = 前一日基金资产净值 X 0.016% / 当年天数。

指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元整。

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**

无。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**7.4.9 关联方关系**

关联方名称	与本基金的关系
国海证券	基金管理人的股东、基金代销机构
中国农业银行	基金托管人、基金代销机构

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年9月3日（基金合同生效日）至2009年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例
国海证券	479,305,331.45	12.51%	973,660,782.99	19.43%

**7.4.10.1.2 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年9月3日（基金合同生效日） 至2009年12月31日	
	成交金额	占当期债券成 交总额的比 例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
国海证券	157,261.58	4.52%	-	-

**7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国海证券	399,619.71	12.45%	65,811.67	6.97%
关联方名称	上年度可比期间 2009年9月3日（基金合同生效日）至2009年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国海证券	814,701.47	19.39%	287,478.65	15.70%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

**7.4.10.2 关联方报酬**

**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年9月3日（基金合同生效 日）至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	13,575,199.69	6,811,672.31
其中：支付销售机构的客户维护费	2,293,210.53	949,817.78

注：支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.85% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.85% / 当年天数。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年9月3日（基金合同生效 日）至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,395,623.40	1,202,059.84

注：支付基金托管人农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年9月3日（基金合同生效 日）至2009年12月31日
期初持有的基金份额	22,006,161.97	0.00
期间申购/买入总份额	0.00	22,006,161.97
期间因拆分变动份额	0.00	0.00

减：期间赎回/卖出总份额	22,006,161.97	0.00
期末持有的基金份额	0.00	22,006,161.97
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0%	1.25%

#### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2010 年 12 月 31 日		上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
国海证券有限 责任公司	0.00	0.00%	29,999,300.00	1.70%
邓普顿国际股 份有限公司 (Templeton Internationa l, Inc.)	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中国农业银行 股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%

注：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2009 年 9 月 3 日（基金合同生效日） 至 2009 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	68,122,333.71	783,800.60	129,276,680.47	977,858.89

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内和上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

报告期内本基金未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2010 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘 单价	数量（股）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000059	辽通化工	2010-12-02	重大资产重组	11.59	-	-	116,181	1,149,965.79	1,346,537.79	-
000652	泰达股份	2010-11-22	筹划重大事项	7.78	-	-	200,158	1,473,867.55	1,557,229.24	-
000959	首钢股份	2010-10-29	重大资产重组	4.42	-	-	249,864	1,233,512.71	1,104,398.88	-
600518	康美药业	2010-12-28	配股	19.71	2011-01-06	17.29	193,697	2,181,674.09	3,817,767.87	-
600664	哈药股份	2010-12-29	重大资产重组	22.57	2011-02-16	24.83	135,954	2,386,347.82	3,068,481.78	-
600816	安信信托	2010-06-02	重要事项未公告	13.60	-	-	75,897	1,151,361.30	1,032,199.20	-

注：本基金截至 2010 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

报告期末本基金没有正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 1,170,835,457.83 元，属于第二层级的余额为 11,926,614.76 元，无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日：第一层级 1,891,102,916.55 元，第二层级 46,841,196.24 元，无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009 年会计期间：同)。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	1,182,762,072.59	94.21
	其中：股票	1,182,762,072.59	94.21
2	固定收益投资	-	-



	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	68,527,572.15	5.46
6	其他各项资产	4,170,223.12	0.33
7	合计	1,255,459,867.86	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,017,125.72	0.24
B	采掘业	110,639,978.99	8.84
C	制造业	318,736,565.74	25.48
C0	食品、饮料	50,202,584.52	4.01
C1	纺织、服装、皮毛	3,396,510.74	0.27
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	19,913,375.31	1.59
C5	电子	7,894,299.33	0.63
C6	金属、非金属	76,934,150.29	6.15
C7	机械、设备、仪表	115,056,845.35	9.20
C8	医药、生物制品	42,339,137.42	3.38
C99	其他制造业	2,999,662.78	0.24
D	电力、煤气及水的生产和供应业	20,255,000.37	1.62
E	建筑业	26,246,508.14	2.10
F	交通运输、仓储业	39,867,613.70	3.19
G	信息技术业	29,831,652.07	2.38
H	批发和零售贸易	26,378,636.43	2.11
I	金融、保险业	242,555,567.25	19.39
J	房地产业	47,214,650.12	3.77
K	社会服务业	8,213,159.80	0.66
L	传播与文化产业	1,286,400.00	0.10
M	综合类	18,740,714.74	1.50
	合计	892,983,573.07	71.38

### 8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	140,765,208.82	11.25
C0	食品、饮料	3,830,869.68	0.31
C1	纺织、服装、皮毛	50,661,514.87	4.05
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	16,460,150.34	1.32
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	34,905,005.96	2.79
C7	机械、设备、仪表	27,243,383.37	2.18
C8	医药、生物制品	7,664,284.60	0.61
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	73,787,432.20	5.90
I	金融、保险业	64,365,594.50	5.14
J	房地产业	10,860,264.00	0.87
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	289,778,499.52	23.16

### 8.3 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

#### 8.3.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	542,345	30,458,095.20	2.43
2	600036	招商银行	2,206,931	28,270,786.11	2.26
3	601939	建设银行	4,510,594	20,703,626.46	1.65
4	601328	交通银行	3,369,135	18,462,859.80	1.48
5	600016	民生银行	3,656,405	18,355,153.10	1.47
6	600000	浦发银行	1,369,969	16,973,915.91	1.36

7	601166	兴业银行	679,025	16,330,551.25	1.31
8	600030	中信证券	1,267,680	15,960,091.20	1.28
9	601088	中国神华	533,906	13,192,817.26	1.05
10	000002	万科 A	1,566,943	12,880,271.46	1.03

注：投资者欲了解本报告期末本基金指数投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人公司网站的年度报告正文。

### 8.3.2 期末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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002291	星期六	2,637,247	50,661,514.87	4.05
2	600036	招商银行	3,227,450	41,343,634.50	3.30
3	000715	中兴商业	2,149,912	32,313,177.36	2.58
4	600690	青岛海尔	947,997	26,742,995.37	2.14
5	002024	苏宁电器	1,996,172	26,149,853.20	2.09

注：投资者欲了解本报告期末本基金积极投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人公司网站的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600362	江西铜业	66,663,178.58	3.27
2	600036	招商银行	63,975,139.29	3.14
3	002291	星期六	54,955,466.48	2.69
4	600000	浦发银行	47,955,567.61	2.35
5	601318	中国平安	39,334,284.69	1.93
6	002154	报喜鸟	35,934,610.61	1.76
7	600694	大商股份	32,478,700.99	1.59
8	002024	苏宁电器	31,851,704.79	1.56
9	000715	中兴商业	31,851,058.46	1.56
10	601328	交通银行	29,912,699.00	1.47
11	600050	中国联通	29,491,814.28	1.45
12	000987	广州友谊	27,846,570.46	1.37
13	600690	青岛海尔	27,724,984.90	1.36
14	000061	农产品	27,405,750.23	1.34

15	000002	万科 A	26,322,362.70	1.29
16	600596	新安股份	25,895,192.39	1.27
17	600276	恒瑞医药	24,755,801.36	1.21
18	601857	中国石油	24,679,879.24	1.21
19	002020	京新药业	23,872,435.50	1.17
20	002037	久联发展	22,284,614.44	1.09

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600694	大商股份	139,544,117.31	6.84
2	600362	江西铜业	71,208,809.78	3.49
3	600036	招商银行	68,739,865.50	3.37
4	600875	东方电气	57,186,026.36	2.80
5	600000	浦发银行	51,664,763.22	2.53
6	601318	中国平安	50,269,294.48	2.46
7	002154	报喜鸟	43,697,943.97	2.14
8	601328	交通银行	41,545,772.68	2.04
9	000792	盐湖钾肥	41,457,112.46	2.03
10	600050	中国联通	37,293,346.46	1.83
11	000729	燕京啤酒	33,345,464.09	1.63
12	601398	工商银行	30,404,001.64	1.49
13	000061	农产品	30,284,594.48	1.48
14	000783	长江证券	30,120,814.43	1.48
15	000651	格力电器	29,846,641.40	1.46
16	000987	广州友谊	29,564,753.28	1.45
17	002020	京新药业	28,509,883.17	1.40
18	600276	恒瑞医药	28,152,201.20	1.38
19	601857	中国石油	28,149,191.86	1.38
20	600739	辽宁成大	27,465,387.29	1.35

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,597,604,918.96
卖出股票的收入（成交）总额	2,251,845,766.56

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

**8.6 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**

本基金报告期末未持有债券。

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细**

本基金报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 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**

本基金报告期末未持有权证。

**8.9 投资组合报告附注**

**8.9.1** 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。

**8.9.2** 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。

**8.9.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	520,262.84
2	应收证券清算款	3,143,592.05
3	应收股利	-
4	应收利息	13,727.67
5	应收申购款	492,640.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,170,223.12

**8.9.4 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换债券。

**8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

截至期末，本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

**8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

截至期末，本基金积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

**8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

报告期内本基金未主动投资股权分置改革中发行的权证。

**§ 9 基金份额持有人信息****9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
44,621	25,805.55	267,755,506.88	23.25%	883,714,111.01	76.75%

**9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况**

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	151,275.94	0.013%

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日(2009年9月3日)基金份额总额	2,423,832,173.19
本报告期期初基金份额总额	1,766,336,321.55
本报告期基金总申购份额	1,243,321,180.21
减：本报告期基金总赎回份额	1,858,187,883.87
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,151,469,617.89

**§ 11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

### （一）基金管理人重大人事变动

1、经国海富兰克林基金管理有限公司第二届董事会第十六次会议审议通过，任命李彪先生担任公司督察长。相关公告已于 2010 年 4 月 21 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站披露；

2、经国海富兰克林基金管理有限公司 2010 年股东会第一次会议审议通过，任命吴显玲女士担任公司董事长。相关公告已于 2010 年 6 月 2 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站披露。

### （二）基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

2010 年度中国农业银行基金托管部门无重大人事变动。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人应支付给会计师事务所的审计费用是人民币 100,000.00 元，本基金自成立以来对其进行审计的均为普华永道中天会计师事务所，未曾改聘其他会计师事务所。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	--------	------	-----------	----

		成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	佣金	占当期 佣金总 量的比 例	
联合证券	2	547,136,527.74	14.28%	456,606.52	14.23%	-
国海证券	2	479,305,331.45	12.51%	399,619.71	12.45%	-
国信证券	1	444,259,270.19	11.59%	377,620.43	11.77%	-
财富证券	1	423,468,844.74	11.05%	344,070.77	10.72%	-
国金证券	1	327,135,770.39	8.54%	278,064.89	8.67%	-
齐鲁证券	1	296,648,746.61	7.74%	252,150.55	7.86%	-
国泰君安	1	270,679,775.89	7.06%	219,929.61	6.85%	-
中信证券	2	248,819,891.95	6.49%	208,148.33	6.49%	-
安信证券	1	234,601,572.06	6.12%	199,408.96	6.21%	-
海通证券	1	183,017,020.19	4.78%	155,564.11	4.85%	-
中金公司	2	173,308,571.87	4.52%	144,254.13	4.50%	-
高华证券	1	122,148,116.45	3.19%	103,825.41	3.24%	-
申银万国	1	47,094,840.22	1.23%	40,030.51	1.25%	-
中信建投	1	34,473,423.81	0.90%	29,302.35	0.91%	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序

1) 选择代理基金证券买卖的证券经营机构的标准

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，并租用其交易单元作为基金的专用交易单元。选择的标准是：

- ① 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- ② 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚；
- ③ 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- ④ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- ⑤ 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2) 租用基金专用交易单元的程序

① 基金管理人根据上述标准考察证券经营机构，考察结果经公司领导审批后，我司与被选中的证券经营机构签订《券商交易单元租用协议》和《研究服务协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。

② 之后，基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况，根据如下选择标准细化的评价体系，每季度对签约证券经营机构的服务进行一次综合评价：

- A 提供的研究报告质量和数量；
- B 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；
- C 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；
- D 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；
- E 其他可评价的量化标准。

经过评价，对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留，并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构



违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。

③ 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

## 2、报告期内证券公司基金专用交易单元的租用与变更情况

报告期内，根据上述基金专用报告期内，根据上述基金专用交易单元选择标准和程序，本基金逐步租用证券公司的交易单元合计 20 个：其中国海证券、中信证券、中金公司和联合证券各 2 个，申银万国证券、海通证券、中信建投证券、银河证券、招商证券、国泰君安证券、齐鲁证券、国信证券、高华证券、财富证券、安信证券和国金证券各 1 个。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 回购成 交总额 的比例	成交金额	占当期权 证成交总 额的比例
国海证券	157,261.58	4.52%	-	-	-	-
财富证券	21,249.49	0.61%	-	-	-	-
国金证券	-	-	50,000,000.00	100.00%	-	-
海通证券	201,450.00	5.79%	-	-	-	-
申银万国	3,099,217.40	89.08%	-	-	-	-

国海富兰克林基金管理有限公司

二〇一一年三月二十六日