

# 富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基 金

## 2011 年半年度报告

### 2011 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：二〇一一年八月二十九日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半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 8 月 19 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，投资者在做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 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	7
2.5	其他相关资料.....	7
3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	8
4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
5	托管人报告.....	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	15
6.1	资产负债表.....	15
6.2	利润表.....	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4	报表附注.....	18
7	投资组合报告.....	41
7.1	期末基金资产组合情况.....	41
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
7.6	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.....	53
7.7	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.....	53
7.8	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.....	53

7.9	投资组合报告附注.....	53
8	基金份额持有人信息.....	54
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	54
9	开放式基金份额变动.....	54
10	重大事件揭示.....	55
10.1	基金份额持有人大会决议.....	55
10.2	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.....	55
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4	基金投资策略的改变.....	55
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	55
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8	其他重大事件.....	58
11	备查文件目录.....	60
11.1	备查文件目录.....	60
11.2	存放地点.....	60
11.3	查阅方式.....	61

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金
基金简称	国富沪深300指数增强
基金主代码	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	1,036,244,309.84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：</p> <p>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：</p> <p>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</p>

	<p>与比较基准的偏离程度，适时对投资组合进行调整，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：</p> <p>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，进行优化选样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	李芳菲
	联系电话	021-3855 5555	010-6606 0069
	电子邮箱	service@ftsfund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		021-38789555、 400-700-4518 和 9510-5680	95599
传真		021-6888 0981	010-6320 1816
注册地址		广西南宁市琅东滨湖路 46 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区富城路 99 号 震旦国际大楼 18 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心

邮政编码	200120	100031
法定代表人	吴显玲	项俊波

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国海富兰克林基金管理有限公司	上海市浦东新区富城路99号震旦国际大楼18楼

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期（2011年1月1日至2011年6月30日）
本期已实现收益	17,443,905.59
本期利润	-33,130,303.99
加权平均基金份额本期利润	-0.0302
本期加权平均净值利润率	-2.80%
本期基金份额净值增长率	-3.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	51,619,255.83
期末可供分配基金份额利润	0.050
期末基金资产净值	1,087,863,565.67
期末基金份额净值	1.050
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	5.00%

注：1. 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—第1号《主要财务指标的计算及披露》。

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. 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）。

4. 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
过去一个月	2.44%	1.14%	1.36%	1.13%	1.08%	0.01%
过去三个月	-4.28%	1.03%	-5.26%	1.04%	0.98%	-0.01%
过去六个月	-3.40%	1.15%	-2.50%	1.17%	-0.90%	-0.02%
过去一年	20.27%	1.30%	17.93%	1.33%	2.34%	-0.03%
自基金合同生效起至今	5.00%	1.38%	5.36%	1.47%	-0.36%	-0.09%

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：

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

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

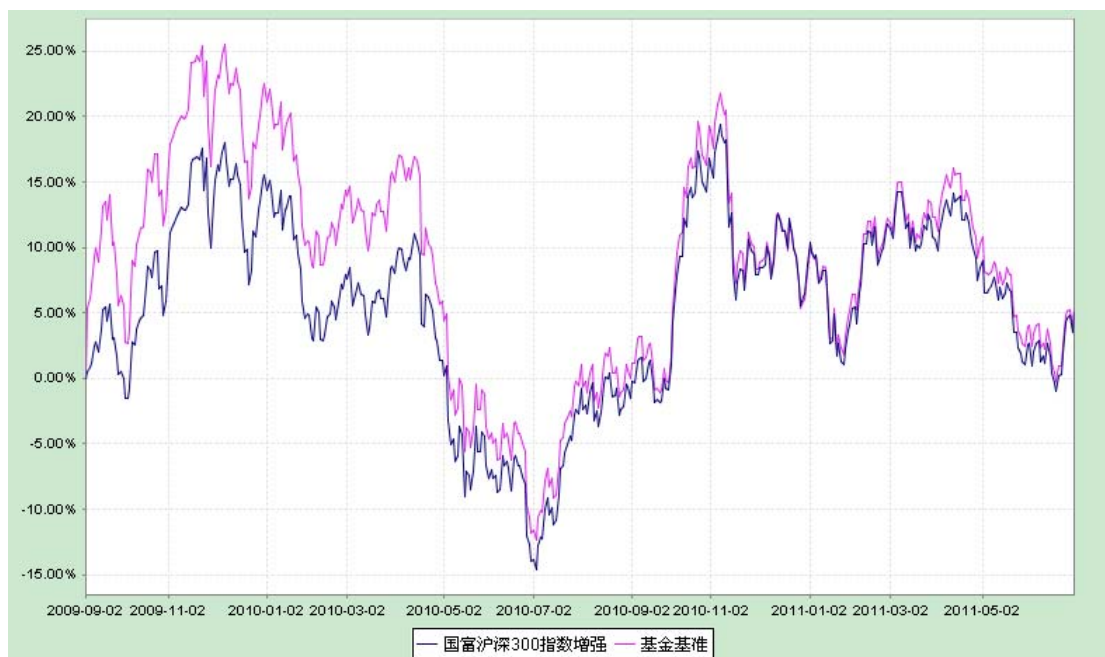
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 2011 年 6 月 30 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、截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同的约定。基金合同中关于基金投资比例的约定如下：

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。

## 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，并经中国证券监督管理委员会批准，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，相关工商注册变更登记手续已完成。

本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），丰富优秀的基金管理能力也获得多方权威机构好评。

1. 富兰克林国海弹性市值股票型基金荣获晨星（Morningstar）五年期股票型基金五星评级。（截至 2011 年 6 月末）

2. 富兰克林国海弹性市值股票型基金荣获晨星（Morningstar）三年期股票型基金四星评级。（截至 2011 年 6 月末）

3. 富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金在《上海证券报》报社主办的第七届中国“金基金奖”评选中荣获 2009 年度“金基金三年期产品奖”。

4. 《证券时报》2010 年 5 月 19 日公布：富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金获得 2009 年度三年持续回报股票型明星基金奖。

5. 富兰克林国海潜力组合股票型基金荣获晨星（Morningstar）三年期股票型基金四星评级。（截至 2011 年 6 月末）

#### 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、富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金经理	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，国富弹性市值股票基金基金经理助理和国富潜力

					组合股票基金基金经理助理。从事煤炭、机械、汽车、交通运输和 IT 等行业的研究工作。现任本基金经理，并同时担任富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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，共管理了七只产品，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”、“兴业国富互惠一号”、“兴业国富互惠二号”、

“中行国富互惠一号”和“中行国富配置二号”。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说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年上半年，国内的证券 A 股市场基本呈现震荡的格局，沪深 300 指数下跌 2.69%。从市场的表现来看，2011 年上半年，建材，食品饮料，家电，黑色金属，房地产，采掘等消费和保障房相关行业表现较好，医药，电气设备，信息技术等行业受到增长大幅减缓影响，表现较差。上半年，受到货币紧缩与高通胀的双重影响，经济增长趋稳和通胀预期的不断深化，以及货币政策的持续从紧，对市场的格局形成了较大的影响，尤其中小市值股票继续受到估值和业绩不及预期的压力，上半年有了较大幅度的调整。银行板块由于受到融资平台坏账担忧，二季度出现了较大的调整。总体看，上半年市场从高铁建设，水利建设和稀有矿产的主题投资逐渐转向对国内经济担忧加重，市场出现较强的避险氛围，投资者逐步降低权益资产配置。从国际上看，美国二次数量宽松政策的逐步到期，欧债局势再现波澜，大宗商品持续走高对经济复苏形成了新的负面影响，对全球经济增长前景担忧加重，全球股市全面调整。

上半年，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，超配大消费行业，特别是零售，保险和地产等行业。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.05 元，本报告期基金份额净值增长率为 -3.40%，同期业绩基准增长率为 -2.5%，基金落后业绩基准 0.90 个百分点，跟踪误差为 2.02%，符合合同约定。本基金配置了较多的消费和中市值股票，是上半年跑输市场的主要

原因。

#### 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 年下半年，我们认为，国内通胀水平将相对平稳缓和，政府进一步加快保障房的开工建设，预计经济仍然维持较快的增长，但货币政策仍然偏紧，地产政策不会放松，地方债务危机仍然危机四伏；中国经济增长方式从中期看，依旧维持惯性运行，投资拉动为主的方式短期不变，特别是保障房与水利，中西部建设等投资成为增长的主要动力；中国的内需，特别是消费，在国家采取一些让利的政策后，增长将趋于稳定，要出现较快的增长，政府还需要在税收上继续让利。下半年，进出口贸易方面，顺差较去年可能继续减少，人民币升值维持平稳上升态势。总体上看，宏观经济层面更加复杂，通胀与增长如何平衡，货币政策适度从紧是否继续维持，对实体经济负面影响是否改变政府控通胀的决心，在短期对市场有较大的影响。代表市场总体的沪深 300 指数整体估值虽不高，但经济的波动对大盘股的利润影响较大，特别是在高通胀环境下，企业利润的增长有时跟不上经济增长的步伐，估值回升有较大的难度；而医药和部分消费行业，经过调整以后，行业机会已经到来；中小盘在经过大幅调整后，较多公司价值凸现，我们将适时提高权重。

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”），并已制订了《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自 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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投资运作遵规守信、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以及基金费用开支等事项上,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 托管人对本半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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 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：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	55,306,384.79	68,122,333.71
结算备付金		290,384.26	405,238.44
存出保证金		138,127.53	520,262.84
交易性金融资产	6.4.7.2	1,032,722,107.59	1,182,762,072.59
其中：股票投资		1,032,570,690.39	1,182,762,072.59
基金投资		-	-
债券投资		151,417.20	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	3,143,592.05
应收利息	6.4.7.5	10,319.38	13,727.67
应收股利		897,711.77	-
应收申购款		391,302.75	492,640.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,089,756,338.07	1,255,459,867.86
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负债：			
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		400,277.02	1,786,042.21
应付管理人报酬		736,469.51	946,456.19
应付托管费		129,965.19	167,021.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	221,988.93	944,068.67

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	404,071.75	535,183.47
负债合计		1,892,772.40	4,378,772.21
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,036,244,309.84	1,151,469,617.89
未分配利润	6.4.7.10	51,619,255.83	99,611,477.76
所有者权益合计		1,087,863,565.67	1,251,081,095.65
负债和所有者权益总计		1,089,756,338.07	1,255,459,867.86

注：1. 报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.050 元，基金份额总额 1,036,244,309.84 份。

2. 后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

## 6.2 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-25,929,835.23</b>	<b>-438,829,626.17</b>
1.利息收入		249,213.93	449,595.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	248,387.02	443,814.76
债券利息收入		826.91	251.83
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）		23,868,965.92	50,573,332.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12.1	15,376,519.59	42,234,881.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	171,355.64	649.49
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	8,321,090.69	8,337,801.37



3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-50,574,209.58	-490,816,762.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	526,194.50	964,207.85
<b>减：二、费用</b>		<b>7,200,468.76</b>	<b>11,725,984.17</b>
1. 管理人报酬		4,991,357.28	7,199,848.67
2. 托管费		880,827.75	1,270,561.46
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,015,587.69	2,902,339.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	312,696.04	353,234.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-33,130,303.99</b>	<b>-450,555,610.34</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-33,130,303.99</b>	<b>-450,555,610.34</b>

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 6.3 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：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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）	1,151,469,617.89	99,611,477.76	1,251,081,095.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-33,130,303.99	-33,130,303.99
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）	-115,225,308.05	-14,861,917.94	-130,087,225.99
其中：1. 基金申购款	368,849,091.82	34,720,132.39	403,569,224.21
2. 基金赎回款	-484,074,399.87	-49,582,050.33	-533,656,450.20
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）	1,036,244,309.84	51,619,255.83	1,087,863,565.67
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 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）	-	-450,555,610.34	-450,555,610.34
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）	-164,760,480.70	-27,094,503.38	-191,854,984.08
其中：1. 基金申购款	549,651,417.02	29,843,753.37	579,495,170.39
2. 基金赎回款	-714,411,897.72	-56,938,256.75	-771,350,154.47
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）	1,601,575,840.85	-204,085,937.23	1,397,489,903.62

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

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

芳

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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》核准，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:  $95\% \times \text{沪深 300 指数} + 5\% \times \text{同业存款利率}$ 。

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 8 月 26 日批准报出。

#### 6.4.2 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 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告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 2011

年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **6.4.4.1 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。本会计报表的实际编制期间为 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日。比较会计报表的实际编制期间为 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日。

##### **6.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **6.4.4.3 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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 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。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管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。

#### **6.4.4.11 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。

#### **6.4.4.12 外币交易**

无。

#### **6.4.4.13 分部报告**

无。

#### **6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**

(i) 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

## (2) 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和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(a) 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。本基金自 2009 年 6 月 15 日起, 采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数以取代原交易所发布的行业指数。

(b) 在银行间同业市场交易的债券品种, 根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值, 具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 6.4.6 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：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
活期存款	55,306,384.79
定期存款	-
其他存款	-
合计	55,306,384.79

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,050,661,996.45	1,032,570,690.39	-18,091,306.06
债券	交易所市场	132,000.00	151,417.20
	银行间市场	-	-
	合计	132,000.00	151,417.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	1,050,793,996.45	1,032,722,107.59	-18,071,888.86

注：于 2011 年 6 月 30 日，股票投资余额中按照指数收益法估值的特殊事项停牌相关股票：无。

#### 6.4.7.3 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；

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 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。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	10,054.20
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	117.63
应收债券利息	147.55
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	10,319.38

#### 6.4.7.6 其他资产

截至报告期末，本基金持有的其他资产余额为零。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	221,988.93
银行间市场应付交易费用	-
合计	221,988.93

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2011 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	995.71
应付后端申购费	-
债券利息税	-
预提费用	358,273.08
银行手续费	-
应付指数使用费	44,802.96
合计	404,071.75

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,151,469,617.89	1,151,469,617.89
本期申购	368,849,091.82	368,849,091.82
本期赎回（以“-”号填列）	-484,074,399.87	-484,074,399.87
本期末	1,036,244,309.84	1,036,244,309.84

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.10 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	149,251,451.04	-49,639,973.28	99,611,477.76
本期利润	17,443,905.59	-50,574,209.58	-33,130,303.99
本期基金份额交易产生的变动数	-16,465,956.18	1,604,038.24	-14,861,917.94
其中：基金申购款	50,457,607.56	-15,737,475.17	34,720,132.39
基金赎回款	-66,923,563.74	17,341,513.41	-49,582,050.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	150,229,400.45	-98,610,144.62	51,619,255.83

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	4,077.18
其他	4,070.32
合计	248,387.02

## 6.4.7.12 股票投资收益

## 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	15,376,519.59
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	15,376,519.59

## 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	372,846,962.48
减：卖出股票成本总额	357,470,442.89
买卖股票差价收入	15,376,519.59

## 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,386,035.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,214,000.00
减：应收利息总额	679.36
债券投资收益	171,355.64

## 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

## 6.4.7.15 衍生工具收益

## 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,321,090.69
基金投资产生的股利收益	0.00
合计	8,321,090.69

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-50,574,209.58
——股票投资	-50,593,626.78
——债券投资	19,417.20
——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	-50,574,209.58

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	525,055.84
转换费收入	1,138.66
合计	526,194.50

注：1. 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。

2. 本基金的转换费由申购费补差和转出基金赎回费构成，其中转出赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	1,015,587.69
银行间市场交易费用	-
合计	1,015,587.69

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	158,684.51
银行汇划费用	470.00
债券账户维护费	9,000.00
其他手续费	150.00
指数使用费	94,802.96

合计	312,696.04
----	------------

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。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

报告期内本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
国海证券股份有限公司（“国海证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
邓普顿国际股份有限公司 (Templeton International, Inc.)	基金管理人的股东

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	-	-	398,306,980.02	21.59%

**6.4.10.1.2 权证交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券交易**

无。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	333,808.04	21.61%	78,254.60	9.57%

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、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	4,991,357.28
其中：支付销售机构的客户 维护费	701,888.06	1,269,616.88

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。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	880,827.75	1,270,561.46

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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

报告期末本基金没有发生销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本会计期间未与关联方进行银行间同业市场的债券、回购交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
期初持有的基金份额	0.00	22,006,161.97
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	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%	1.37%

##### 6.4.10.4.2 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 2011年6月30日		上年度末 2010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
国海证券股份有 限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
邓普顿国际股份 有限公司 (Templeton)	0.00	0.00%	0.00	0.00%



International, Inc.)				
中国农业银行股份 有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%

## 6.4.10.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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 股份有限公司	55,306,384.79	240,239.52	95,088,023.92	435,344.15

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。

## 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期和上年度可比期间（2010年1月1日至2010年6月30日）均未在承销期内参与关联方承销证券。

## 6.4.11 利润分配情况

报告期内本基金未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 6.4.12.2 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
600170	上海建工	2011-06-30	资产重组	15.59	2011-07-04	16.25	48,489	678,858.74	755,943.51	-
600216	浙江医药	2011-06-27	重大事项	31.39	2011-07-04	32.60	36,631	1,193,813.21	1,149,847.09	-

600369	西南证券	2011-03-01	资产重组	11.87	2011-08-16	12.49	78,168	1,293,861.75	927,854.16	-
000652	泰达股份	2010-11-22	重大事项	7.68	2011-07-08	7.68	200,158	1,473,867.55	1,537,213.44	-
000876	新希望	2011-06-29	资产重组	19.95	2011-07-05	21.95	48,469	601,949.91	966,956.55	-
000959	首钢股份	2010-10-29	资产重组	4.42	-	-	249,864	1,233,512.71	1,104,398.88	-

注：本基金截至 2011 年 6 月 30 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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

报告期末本基金没有正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只指数增强型证券投资基金，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括市场风险、流动性风险、信用风险和操作风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是根据基金投资目标，跟踪监控基金组合与标的指数的偏差，将基金与业绩比较基准的跟踪误差控制在预定的范围内。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以董事会合规与风险控制委员会为核心的、由公司风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险控制委员会，负

责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，建立了业务部门内各岗位、部门和部门之间的自控和互控为基础的防线，并由监察稽核部对各岗位、各部门、各项业务全面实施监督反馈，由风险控制部负责投资风险管理及绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，主要是发掘各类风险的风险点，判断风险发生的频度和损失，对风险实行分级管理。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的分析报告，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，及时对各种风险进行监控和评估，并通过风险处置流程，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险指在基金投资及交易过程中，因交易对手违约而产生的交割风险，以及基金所投资证券之发行人出现拒绝支付利息或到期拒绝支付本息的违约，或由于所投资证券或其发行人信用质量下降而导致证券价格下跌的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行的交易均只与内部评估认可的交易对手库中的交易对手进行，并根据交易对手信用状况对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2011 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券占基金资产净值的比例为 0.01%（2010 年 12 月 31 日：0.00%）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与

由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持全部证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因各类市场因素的变动而发生波动，导致基金资产损失或偏离投资目标的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6 月30日	1年以 内	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	55,306,3 84.79	-	-	-	55,306,3 84.79
结算备付 金	290,384. 26	-	-	-	290,384. 26
存出保证 金	-	-	-	138,127. 53	138,127. 53
交易性金 融资产	-	-	151,417. 20	1,032,57 0,690.39	1,032,72 2,107.59
应收股利	-	-	-	897,711. 77	897,711. 77

应收利息	-	-	-	10,319.3 8	10,319.3 8
应收申购款	4,970.18	-	-	386,332. 57	391,302. 75
资产总计	55,601,7 39.23	-	151,417. 20	1,034,00 3,181.64	1,089,75 6,338.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	400,277. 02	400,277. 02
应付管理人报酬	-	-	-	736,469. 51	736,469. 51
应付托管费	-	-	-	129,965. 19	129,965. 19
应付交易费用	-	-	-	221,988. 93	221,988. 93
其他负债	-	-	-	404,071. 75	404,071. 75
负债总计	-	-	-	1,892,77 2.40	1,892,77 2.40
利率敏感度缺口	55,601,7 39.23	-	151,417. 20	1,032,11 0,409.24	1,087,86 3,565.67
上年度末 2010年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	68,122,3 33.71	-	-	-	68,122,3 33.71
结算备付金	405,238. 44	-	-	-	405,238. 44
存出保证金	-	-	-	520,262. 84	520,262. 84
交易性金融资产	-	-	-	1,182,76 2,072.59	1,182,76 2,072.59
应收利息	-	-	-	13,727.6	13,727.6

				7	7
应收申购款	7,933.36	-	-	484,707.20	492,640.56
应收证券清算款	-	-	-	3,143,592.05	3,143,592.05
资产总计	68,535,505.51	-	-	1,186,924,362.35	1,255,459,867.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,786,042.21	1,786,042.21
应付管理人报酬	-	-	-	946,456.19	946,456.19
应付托管费	-	-	-	167,021.67	167,021.67
应付交易费用	-	-	-	944,068.67	944,068.67
其他负债	-	-	-	535,183.47	535,183.47
负债总计	-	-	-	4,378,772.21	4,378,772.21
利率敏感度缺口	68,535,505.51	-	-	1,182,545,590.14	1,251,081,095.65

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

1、于 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

2、于 2011 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.01%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同

业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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标的的投资收益，追求基金资产的长期增值。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过资产配置调整和组合分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 85%-95%，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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对市场价格风险进行监控。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,032,570,690.39	94.92	1,182,762,072.59	94.54
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,032,570,690.39	94.92	1,182,762,072.59	94.54

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	沪深300指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币 万元）	
		本期末	上年度末

		2011 年 6 月 30 日	2010 年 12 月 31 日
	沪深300指数上升5%	增加约5,163	增加约5,441
	沪深300指数下降5%	减少约5,163	减少约5,441

#### 6.4.14 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 2011 年 6 月 30 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 1,026,128,476.76 元，属于第二层级的余额为 6,442,213.63 元，无属于第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日：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)。

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。

(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。



## 7 投资组合报告

## 7.1 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	1,032,570,690.39	94.75
	其中：股票	1,032,570,690.39	94.75
2	固定收益投资	151,417.20	0.01
	其中：债券	151,417.20	0.01
	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	55,596,769.05	5.10
6	其他各项资产	1,437,461.43	0.13
7	合计	1,089,756,338.07	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 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	5,034,505.77	0.46
B	采掘业	93,935,882.33	8.63
C	制造业	282,307,884.75	25.95
C0	食品、饮料	45,446,623.09	4.18
C1	纺织、服装、皮毛	3,395,288.93	0.31
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	0.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	18,284,695.08	1.68
C5	电子	9,802,754.15	0.90
C6	金属、非金属	69,113,245.46	6.35
C7	机械、设备、仪表	104,114,543.00	9.57
C8	医药、生物制品	30,789,415.92	2.83
C99	其他制造业	1,361,319.12	0.13
D	电力、煤气及水的生产和供应业	16,445,258.61	1.51

E	建筑业	24,082,457.52	2.21
F	交通运输、仓储业	29,787,505.66	2.74
G	信息技术业	24,061,169.25	2.21
H	批发和零售贸易	24,695,870.96	2.27
I	金融、保险业	209,946,331.86	19.30
J	房地产业	38,173,596.41	3.51
K	社会服务业	6,364,374.92	0.59
L	传播与文化产业	1,592,882.95	0.15
M	综合类	14,662,672.04	1.35
	合计	771,090,393.03	70.88

## 7.2.2 积极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	0.00	0.00
B	采掘业	3,935,887.60	0.36
C	制造业	77,516,496.31	7.13
C0	食品、饮料	11,891,146.46	1.09
C1	纺织、服装、皮毛	29,111,607.22	2.68
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	0.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,612,625.80	0.52
C5	电子	0.00	0.00
C6	金属、非金属	8,324,752.08	0.77
C7	机械、设备、仪表	11,124,016.15	1.02
C8	医药、生物制品	11,452,348.60	1.05
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	8,847,758.00	0.81
F	交通运输、仓储业	0.00	0.00
G	信息技术业	0.00	0.00
H	批发和零售贸易	89,696,230.15	8.25
I	金融、保险业	55,246,785.30	5.08
J	房地产业	21,491,140.00	1.98
K	社会服务业	4,746,000.00	0.44
L	传播与文化产业	0.00	0.00
M	综合类	0.00	0.00
	合计	261,480,297.36	24.04

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

## 7.3.1 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所有股票投资明细

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	600036	招商银行	1,824,129	23,750,159.58	2.18
2	601318	中国平安	487,644	23,538,575.88	2.16
3	600016	民生银行	3,331,424	19,089,059.52	1.75
4	601328	交通银行	3,030,806	16,790,665.24	1.54
5	600000	浦发银行	1,629,662	16,035,874.08	1.47
6	601166	兴业银行	1,099,064	14,815,382.72	1.36
7	601088	中国神华	483,108	14,560,875.12	1.34
8	600030	中信证券	1,020,671	13,350,376.68	1.23
9	000002	万科A	1,439,480	12,163,606.00	1.12
10	601939	建设银行	2,304,330	11,383,390.20	1.05
11	600519	贵州茅台	51,328	10,913,872.64	1.00
12	601601	中国太保	457,623	10,246,178.97	0.94
13	000858	五粮液	278,109	9,934,053.48	0.91
14	600585	海螺水泥	292,934	8,131,847.84	0.75
15	600031	三一重工	444,785	8,023,921.40	0.74
16	002024	苏宁电器	619,336	7,933,694.16	0.73
17	600837	海通证券	856,376	7,724,511.52	0.71
18	601668	中国建筑	1,853,630	7,470,128.90	0.69
19	601006	大秦铁路	871,004	7,133,522.76	0.66
20	600111	包钢稀土	98,793	7,056,783.99	0.65
21	000001	深发展A	405,786	6,926,767.02	0.64
22	000651	格力电器	289,118	6,794,273.00	0.62
23	600050	中国联通	1,261,476	6,622,749.00	0.61
24	601169	北京银行	618,641	6,167,850.77	0.57
25	000063	中兴通讯	211,907	5,992,729.96	0.55
26	601857	中国石油	550,295	5,992,712.55	0.55
27	600048	保利地产	531,904	5,845,624.96	0.54
28	000157	中联重科	367,381	5,650,319.78	0.52
29	601899	紫金矿业	771,538	5,585,935.12	0.51
30	000983	西山煤电	230,674	5,582,310.80	0.51
31	000527	美的电器	287,000	5,277,930.00	0.49
32	600900	长江电力	725,074	5,227,783.54	0.48
33	601989	中国重工	373,880	5,155,805.20	0.47
34	600028	中国石化	609,914	5,019,592.22	0.46

35	600089	特变电工	386,071	4,995,758.74	0.46
36	600547	山东黄金	106,106	4,757,793.04	0.44
37	600104	上海汽车	251,275	4,708,893.50	0.43
38	600015	华夏银行	430,891	4,683,785.17	0.43
39	000568	泸州老窖	102,034	4,603,774.08	0.42
40	600019	宝钢股份	747,415	4,506,912.45	0.41
41	601699	潞安环能	134,952	4,427,775.12	0.41
42	600362	江西铜业	121,564	4,308,228.16	0.40
43	000792	盐湖股份	72,724	4,290,716.00	0.39
44	600348	阳泉煤业	176,055	4,249,967.70	0.39
45	000338	潍柴动力	92,454	4,200,185.22	0.39
46	600383	金地集团	655,209	4,199,889.69	0.39
47	601628	中国人寿	218,216	4,091,550.00	0.38
48	601766	中国南车	574,368	4,089,500.16	0.38
49	600795	国电电力	1,373,178	4,064,606.88	0.37
50	600887	伊利股份	233,410	3,886,276.50	0.36
51	600256	广汇股份	163,167	3,880,111.26	0.36
52	600739	辽宁成大	132,419	3,681,248.20	0.34
53	601168	西部矿业	247,015	3,660,762.30	0.34
54	600489	中金黄金	131,420	3,586,451.80	0.33
55	600068	葛洲坝	296,914	3,559,998.86	0.33
56	601600	中国铝业	306,928	3,379,277.28	0.31
57	600690	青岛海尔	114,255	3,193,427.25	0.29
58	601988	中国银行	1,014,728	3,186,245.92	0.29
59	601299	中国北车	470,856	3,154,735.20	0.29
60	000069	华侨城 A	396,695	3,137,857.45	0.29
61	000423	东阿阿胶	74,178	3,060,584.28	0.28
62	000895	双汇发展	45,877	3,031,093.39	0.28
63	600406	国电南瑞	81,563	2,960,736.90	0.27
64	601390	中国中铁	728,023	2,904,811.77	0.27
65	002202	金风科技	192,946	2,880,683.78	0.26
66	601919	中国远洋	345,747	2,866,242.63	0.26
67	600188	兖州煤业	80,485	2,841,120.50	0.26
68	000060	中金岭南	211,845	2,817,538.50	0.26
69	000425	徐工机械	112,174	2,780,793.46	0.26
70	600518	康美药业	209,221	2,753,348.36	0.25
71	600309	烟台万华	147,021	2,750,762.91	0.25
72	600999	招商证券	146,410	2,691,015.80	0.25
73	600010	包钢股份	319,829	2,670,572.15	0.25
74	601009	南京银行	294,218	2,639,135.46	0.24
75	601618	中国中冶	662,436	2,609,997.84	0.24

76	601398	工商银行	579,608	2,585,051.68	0.24
77	000039	中集集团	117,245	2,565,320.60	0.24
78	601788	光大证券	185,879	2,555,836.25	0.23
79	000009	中国宝安	148,329	2,554,225.38	0.23
80	000709	河北钢铁	561,002	2,535,729.04	0.23
81	601958	金铂股份	131,602	2,533,338.50	0.23
82	601186	中国铁建	418,626	2,532,687.30	0.23
83	600005	武钢股份	606,587	2,517,336.05	0.23
84	002073	软控股份	121,050	2,493,630.00	0.23
85	601898	中煤能源	248,835	2,488,350.00	0.23
86	000402	金融街	329,226	2,459,318.22	0.23
87	600875	东方电气	94,595	2,412,172.50	0.22
88	000937	冀中能源	94,336	2,391,417.60	0.22
89	000623	吉林敖东	74,910	2,307,977.10	0.21
90	000630	铜陵有色	95,061	2,290,970.10	0.21
91	600276	恒瑞医药	76,399	2,289,678.03	0.21
92	600415	小商品城	185,012	2,273,797.48	0.21
93	600132	重庆啤酒	39,484	2,266,381.60	0.21
94	601666	平煤股份	160,462	2,248,072.62	0.21
95	600029	南方航空	286,616	2,247,069.44	0.21
96	600150	中国船舶	30,050	2,223,399.50	0.20
97	000012	南玻A	134,583	2,220,619.50	0.20
98	601688	华泰证券	179,307	2,214,441.45	0.20
99	601111	中国国航	226,505	2,172,182.95	0.20
100	000538	云南白药	37,661	2,149,689.88	0.20
101	600881	亚泰集团	257,525	2,145,183.25	0.20
102	000933	神火股份	137,072	2,084,865.12	0.19
103	000776	广发证券	53,081	2,083,429.25	0.19
104	000528	柳工	91,796	2,077,343.48	0.19
105	000401	冀东水泥	82,757	2,068,097.43	0.19
106	000100	TCL 集团	690,974	2,066,012.26	0.19
107	000783	长江证券	190,655	2,053,354.35	0.19
108	000825	太钢不锈	387,246	1,994,316.90	0.18
109	600058	五矿发展	58,173	1,994,170.44	0.18
110	600100	同方股份	189,222	1,979,262.12	0.18
111	600660	福耀玻璃	190,673	1,975,372.28	0.18
112	600497	驰宏锌锗	89,053	1,963,618.65	0.18
113	600642	申能股份	385,965	1,956,842.55	0.18
114	600123	兰花科创	46,574	1,945,861.72	0.18
115	600143	金发科技	113,824	1,873,543.04	0.17
116	000878	云南铜业	85,450	1,872,209.50	0.17

117	601727	上海电气	267,414	1,850,504.88	0.17
118	000768	西飞国际	167,994	1,849,613.94	0.17
119	000024	招商地产	100,830	1,845,189.00	0.17
120	000758	中色股份	52,013	1,838,659.55	0.17
121	601607	上海医药	108,341	1,820,128.80	0.17
122	000725	京东方 A	662,583	1,808,851.59	0.17
123	600177	雅戈尔	181,663	1,793,013.81	0.16
124	000960	锡业股份	61,521	1,790,261.10	0.16
125	002106	莱宝高科	58,759	1,777,459.75	0.16
126	601117	中国化学	200,509	1,776,509.74	0.16
127	600741	华域汽车	159,594	1,776,281.22	0.16
128	600550	天威保变	97,990	1,764,799.90	0.16
129	601106	中国一重	355,100	1,722,235.00	0.16
130	000898	鞍钢股份	250,670	1,704,556.00	0.16
131	002142	宁波银行	156,522	1,702,959.36	0.16
132	600655	豫园商城	156,258	1,700,087.04	0.16
133	600583	海油工程	264,378	1,697,306.76	0.16
134	000869	张裕 A	17,000	1,679,600.00	0.15
135	600832	东方明珠	216,229	1,675,774.75	0.15
136	600009	上海机场	130,915	1,675,712.00	0.15
137	000422	湖北宜化	79,354	1,660,879.22	0.15
138	600115	东方航空	317,133	1,649,091.60	0.15
139	000778	新兴铸管	156,286	1,648,817.30	0.15
140	600859	王府井	40,841	1,632,414.77	0.15
141	600153	建发股份	182,010	1,619,889.00	0.15
142	600271	航天信息	62,651	1,618,901.84	0.15
143	600600	青岛啤酒	47,259	1,613,422.26	0.15
144	600267	海正药业	42,760	1,596,658.40	0.15
145	600320	振华重工	239,409	1,592,069.85	0.15
146	600664	哈药股份	101,066	1,586,736.20	0.15
147	601118	海南橡胶	128,300	1,580,656.00	0.15
148	601333	广深铁路	383,112	1,574,590.32	0.14
149	000800	一汽轿车	110,381	1,562,994.96	0.14
150	601001	XD 大同煤	91,007	1,547,119.00	0.14
151	002304	洋河股份	12,232	1,543,189.12	0.14
152	000652	泰达股份	200,158	1,537,213.44	0.14
153	600549	厦门钨业	37,005	1,533,117.15	0.14
154	600694	大商股份	39,850	1,523,465.50	0.14
155	600196	复星医药	139,507	1,517,836.16	0.14
156	600166	福田汽车	172,159	1,494,340.12	0.14
157	600395	盘江股份	44,899	1,490,197.81	0.14

158	601998	中信银行	312,977	1,486,640.75	0.14
159	600598	北大荒	104,488	1,462,832.00	0.13
160	002155	辰州矿业	44,568	1,456,927.92	0.13
161	000680	山推股份	82,371	1,448,905.89	0.13
162	600376	首开股份	109,572	1,447,446.12	0.13
163	600535	天士力	35,103	1,443,786.39	0.13
164	600169	太原重工	142,034	1,441,645.10	0.13
165	601808	中海油服	80,266	1,433,550.76	0.13
166	000728	国元证券	126,703	1,431,743.90	0.13
167	600631	百联股份	96,179	1,431,143.52	0.13
168	600208	新湖中宝	226,324	1,409,998.52	0.13
169	601818	光大银行	419,786	1,406,283.10	0.13
170	000625	长安汽车	152,960	1,399,584.00	0.13
171	000729	燕京啤酒	82,074	1,392,795.78	0.13
172	600703	三安光电	84,075	1,378,830.00	0.13
173	000969	安泰科技	69,704	1,361,319.12	0.13
174	600970	中材国际	49,566	1,354,638.78	0.12
175	600997	开滦股份	83,867	1,338,517.32	0.12
176	601018	宁波港	417,700	1,336,640.00	0.12
177	600352	浙江龙盛	139,241	1,333,928.78	0.12
178	002007	华兰生物	39,210	1,330,787.40	0.12
179	000839	中信国安	127,716	1,329,523.56	0.12
180	000562	宏源证券	79,353	1,325,988.63	0.12
181	600582	天地科技	59,404	1,315,204.56	0.12
182	000059	辽通化工	96,698	1,313,158.84	0.12
183	600125	铁龙物流	123,792	1,304,767.68	0.12
184	600812	华北制药	111,766	1,287,544.32	0.12
185	601866	中海集运	349,065	1,270,596.60	0.12
186	600649	城投控股	156,167	1,268,076.04	0.12
187	600085	同仁堂	35,465	1,264,681.90	0.12
188	600316	洪都航空	38,961	1,255,713.03	0.12
189	600811	东方集团	180,957	1,244,984.16	0.11
190	601377	兴业证券	71,800	1,237,114.00	0.11
191	600219	南山铝业	131,072	1,233,387.52	0.11
192	600516	方大炭素	93,694	1,230,202.22	0.11
193	600809	山西汾酒	17,561	1,230,148.05	0.11
194	600331	宏达股份	91,001	1,211,223.31	0.11
195	002128	露天煤业	54,104	1,176,762.00	0.11
196	601179	中国西电	191,594	1,168,723.40	0.11
197	600418	江淮汽车	105,097	1,167,627.67	0.11
198	000061	农产品	73,047	1,165,830.12	0.11

199	002001	新 和 成	39,447	1,161,714.15	0.11
200	600062	双鹤药业	46,768	1,159,378.72	0.11
201	000807	云铝股份	107,664	1,158,464.64	0.11
202	600216	浙江医药	36,631	1,149,847.09	0.11
203	600221	海南航空	161,034	1,149,782.76	0.11
204	600108	亚盛集团	188,871	1,146,446.97	0.11
205	600839	四川长虹	339,269	1,133,158.46	0.10
206	600018	上港集团	289,401	1,128,663.90	0.10
207	601101	昊华能源	17,851	1,126,576.61	0.10
208	600808	马钢股份	323,496	1,125,766.08	0.10
209	002493	荣盛石化	36,400	1,124,396.00	0.10
210	000959	首钢股份	249,864	1,104,398.88	0.10
211	600635	大众公用	178,451	1,052,860.90	0.10
212	002422	科伦药业	17,788	1,049,492.00	0.10
213	000559	万向钱潮	130,000	1,045,200.00	0.10
214	600066	宇通客车	42,353	980,048.42	0.09
215	600588	用友软件	47,422	979,738.52	0.09
216	600804	鹏博士	123,007	970,525.23	0.09
217	000876	新 希 望	48,469	966,956.55	0.09
218	600369	西南证券	78,168	927,854.16	0.09
219	601158	重庆水务	111,545	921,361.70	0.08
220	600879	航天电子	75,640	919,782.40	0.08
221	600118	中国卫星	40,907	916,725.87	0.08
222	600779	水井坊	39,957	895,835.94	0.08
223	600595	中孚实业	88,279	886,321.16	0.08
224	002310	东方园林	9,800	882,000.00	0.08
225	002092	中泰化学	67,026	879,381.12	0.08
226	601718	际华集团	188,900	868,940.00	0.08
227	600971	恒源煤电	21,500	867,740.00	0.08
228	600239	云南城投	67,023	861,915.78	0.08
229	002146	荣盛发展	86,661	849,277.80	0.08
230	600895	张江高科	89,948	849,109.12	0.08
231	002069	獐 子 岛	34,756	844,570.80	0.08
232	600432	吉恩镍业	37,875	843,855.00	0.08
233	000968	煤 气 化	33,243	842,045.19	0.08
234	601098	中南传媒	87,800	836,734.00	0.08
235	600500	中化国际	83,579	834,954.21	0.08
236	601717	郑煤机	22,741	829,136.86	0.08
237	600508	上海能源	33,626	819,465.62	0.08
238	600546	山煤国际	26,257	818,955.83	0.08
239	000999	华润三九	45,623	818,932.85	0.08



240	601918	国投新集	66,478	808,372.48	0.07
241	601558	华锐风电	27,449	802,334.27	0.07
242	600675	中华企业	117,259	797,361.20	0.07
243	600528	中铁二局	91,603	796,030.07	0.07
244	600717	天津港	97,277	795,725.86	0.07
245	600266	北京城建	51,737	778,641.85	0.07
246	600312	平高电气	76,210	773,531.50	0.07
247	600037	歌华有线	74,205	756,148.95	0.07
248	600170	上海建工	48,489	755,943.51	0.07
249	000780	平庄能源	47,350	752,865.00	0.07
250	600220	江苏阳光	145,503	733,335.12	0.07
251	601888	中国国旅	30,719	725,889.97	0.07
252	600008	首创股份	127,936	724,117.76	0.07
253	600456	宝钛股份	24,988	721,153.68	0.07
254	002500	山西证券	78,360	716,994.00	0.07
255	600428	中远航运	98,082	708,152.04	0.07
256	002122	天马股份	55,183	706,342.40	0.06
257	600718	东软集团	62,068	706,333.84	0.06
258	000690	宝新能源	140,486	705,239.72	0.06
259	600737	中粮屯河	68,357	700,659.25	0.06
260	000612	焦作万方	39,149	698,418.16	0.06
261	000027	深圳能源	92,540	697,751.60	0.06
262	600096	云天化	34,439	684,991.71	0.06
263	600183	生益科技	74,393	682,927.74	0.06
264	600481	双良节能	47,200	682,512.00	0.06
265	002399	海普瑞	17,282	668,986.22	0.06
266	600893	航空动力	38,160	659,786.40	0.06
267	600017	日照港	157,555	655,428.80	0.06
268	600269	赣粤高速	136,104	641,049.84	0.06
269	000718	苏宁环球	79,546	636,368.00	0.06
270	000021	长城开发	76,839	636,226.92	0.06
271	600674	XD 川投能	44,248	634,516.32	0.06
272	000951	中国重汽	34,307	633,993.36	0.06
273	600026	中海发展	73,419	619,656.36	0.06
274	600863	内蒙华电	69,287	613,882.82	0.06
275	600380	健康元	66,069	608,495.49	0.06
276	601933	永辉超市	25,100	607,169.00	0.06
277	000031	中粮地产	105,307	602,356.04	0.06
278	000686	东北证券	29,908	601,150.80	0.06
279	600823	世茂股份	40,634	594,475.42	0.05
280	002244	滨江集团	47,208	580,658.40	0.05

281	600998	九州通	46,300	571,805.00	0.05
282	600161	天坛生物	32,156	545,044.20	0.05
283	000536	华映科技	22,827	530,042.94	0.05
284	600307	酒钢宏兴	95,510	523,394.80	0.05
285	600517	置信电气	43,255	522,087.85	0.05
286	600151	航天机电	44,691	515,287.23	0.05
287	600109	国金证券	34,843	506,965.65	0.05
288	600300	维维股份	97,039	499,750.85	0.05
289	002498	汉缆股份	22,900	442,657.00	0.04
290	000961	中南建设	41,516	437,578.64	0.04
291	601107	四川成渝	76,908	432,222.96	0.04
292	601268	二重重装	39,810	431,540.40	0.04
293	601369	陕鼓动力	38,977	427,577.69	0.04
294	600004	白云机场	54,044	426,407.16	0.04
295	002415	海康威视	10,829	425,471.41	0.04
296	002028	思源电气	30,815	421,857.35	0.04
297	000927	一汽夏利	56,353	397,852.18	0.04
298	002294	信立泰	11,307	379,802.13	0.03
299	000685	中山公用	21,346	355,197.44	0.03
300	601519	大智慧	22,630	353,933.20	0.03
301	002405	四维图新	10,379	323,305.85	0.03
302	002385	大北农	8,914	288,813.60	0.03

## 7.3.2 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所有股票投资明细

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	002024	苏宁电器	3,189,741	40,860,582.21	3.76
2	601318	中国平安	600,000	28,962,000.00	2.66
3	600036	招商银行	1,727,450	22,491,399.00	2.07
4	000002	万科A	2,121,200	17,924,140.00	1.65
5	002291	星期六	1,320,757	15,188,705.50	1.40
6	002036	宜科科技	849,994	13,922,901.72	1.28
7	000715	中兴商业	1,306,851	13,316,811.69	1.22
8	000895	双汇发展	179,978	11,891,146.46	1.09
9	600690	青岛海尔	397,997	11,124,016.15	1.02
10	000999	华润三九	499,908	8,973,348.60	0.82
11	002375	亚厦股份	299,924	8,847,758.00	0.81
12	000501	鄂武商A	511,432	8,735,258.56	0.80
13	600585	海螺水泥	299,883	8,324,752.08	0.77
14	600697	欧亚集团	297,238	8,263,216.40	0.76

15	600739	辽宁成大	279,926	7,781,942.80	0.72
16	600309	烟台万华	299,980	5,612,625.80	0.52
17	600827	友谊股份	299,931	5,077,831.83	0.47
18	000069	华侨城 A	600,000	4,746,000.00	0.44
19	601699	潞安环能	119,960	3,935,887.60	0.36
20	600256	广汇股份	150,000	3,567,000.00	0.33
21	002277	友阿股份	150,000	3,288,000.00	0.30
22	000783	长江证券	299,950	3,230,461.50	0.30
23	600062	双鹤药业	100,000	2,479,000.00	0.23
24	000963	华东医药	97,758	2,372,586.66	0.22
25	601166	兴业银行	41,760	562,924.80	0.05

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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	002024	苏宁电器	18,680,360.65	1.49
2	601318	中国平安	14,967,497.00	1.20
3	002036	宜科科技	13,586,445.13	1.09
4	002375	亚厦股份	11,299,728.12	0.90
5	000895	双汇发展	10,901,917.67	0.87
6	000002	万科 A	9,459,670.00	0.76
7	600089	特变电工	8,690,612.10	0.69
8	600697	欧亚集团	8,689,554.01	0.69
9	000963	华东医药	8,361,179.01	0.67
10	600585	海螺水泥	7,309,410.00	0.58
11	000501	鄂武商 A	7,308,124.28	0.58
12	601699	潞安环能	7,144,898.16	0.57
13	300137	先河环保	6,451,975.63	0.52
14	600309	烟台万华	4,874,105.66	0.39
15	600827	友谊股份	4,852,014.05	0.39
16	000069	华侨城 A	4,672,647.30	0.37
17	000999	华润三九	4,288,184.67	0.34
18	002154	报喜鸟	4,059,159.00	0.32
19	600256	广汇股份	3,954,453.00	0.32
20	000651	格力电器	3,797,001.30	0.30

##### 7.4.2 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	600036	招商银行	26,874,748.26	2.15
2	002291	星期六	24,248,150.05	1.94
3	600362	江西铜业	18,878,290.63	1.51
4	600690	青岛海尔	17,283,772.20	1.38
5	002037	久联发展	17,128,896.27	1.37
6	601939	建设银行	12,136,437.59	0.97
7	000715	中兴商业	11,094,005.51	0.89
8	600801	华新水泥	9,894,243.40	0.79
9	600089	特变电工	9,666,833.18	0.77
10	601318	中国平安	7,750,115.66	0.62
11	600581	八一钢铁	6,662,376.00	0.53
12	000651	格力电器	6,563,039.55	0.52
13	300137	先河环保	6,160,696.68	0.49
14	600519	贵州茅台	6,045,676.14	0.48
15	000501	鄂武商 A	5,854,033.44	0.47
16	000963	华东医药	5,301,797.73	0.42
17	002024	苏宁电器	4,208,162.40	0.34
18	601699	潞安环能	4,148,614.52	0.33
19	600030	中信证券	3,810,366.74	0.30
20	000002	万科 A	3,807,822.91	0.30

## 7.4.3 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	257,872,687.47
卖出股票的收入（成交）总额	372,846,962.48

## 7.5 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	151,417.20	0.01

8	其他	-	-
9	合计	151,417.20	0.01

#### 7.6 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

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	110016	川投转债	1,320	151,417.20	0.01

#### 7.7 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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金本报告期内投资的前十名证券中，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。

7.9.2 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。

#### 7.9.3 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	138,127.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	897,711.77
4	应收利息	10,319.38
5	应收申购款	391,302.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,437,461.43

#### 7.9.4 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。

**7.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

截至报告期末，本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

**7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

截至报告期末，本基金积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

**7.9.6 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。

**8 基金份额持有人信息****8.1 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
48,308	21,450.78	279,883,543.82	27.01%	756,360,766.02	72.99%

**8.2 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	141,585.16	0.014%

**9 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	1,151,469,617.89
本报告期基金总申购份额	368,849,091.82
减：本报告期基金总赎回份额	484,074,399.87
本报告期基金拆分变动份额	0.00
本报告期期末基金份额总额	1,036,244,309.84

## 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

经国海富兰克林基金管理有限公司第二届董事会第二十八次会议审议通过，金哲非女士不再担任公司总经理，由副总经理李雄厚先生代为履行总经理职务。相关公告已于 2011 年 5 月 4 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

2011 年 1 月 21 日，中国证监会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格（证监许可【2011】116 号），张健任中国农业银行股份有限公司托管业务部总经理。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自成立以来对其进行审计的均是普华永道中天会计师事务所，未曾改聘其他会计师事务所。

### 10.6 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没有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
中信证券股份有限公司	2	290,629,598.60	46.19%	241,985.02	46.10%	-
联合证券有限责任公司	2	72,532,041.50	11.53%	58,932.68	11.23%	-
海通证券股份有限公司	1	60,630,106.83	9.64%	51,535.56	9.82%	-
财富证券	1	56,134,187.07	8.92%	45,609.10	8.69%	-
国信证券有限责任公司	1	54,696,590.81	8.69%	46,491.86	8.86%	-
安信证券股份有限公司	1	47,534,189.78	7.56%	40,403.93	7.70%	-
齐鲁证券有限公司	1	31,550,157.43	5.01%	26,817.78	5.11%	-
北京高华证券有限责任公司	1	15,457,200.97	2.46%	13,138.68	2.50%	-

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 21 个：其中国海证券、中信证券、中金公司和联合证券各 2 个，兴业证券、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、国金证券和安信证券各 1 个。

### 10.7.2 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
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

联合证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
国信证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有 限公司	2,386,035.00	100.00%	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资 基金2010年第4季度报告	在中国证券报、上 海证券报和证券时 报三大指定报刊和 基金管理人公司网 站披露	2011-1-24
2	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分 基金参加j海通证券股份有限公司基金定期 定额申购费率优惠活动的公告	在中国证券报、上 海证券报和证券时 报三大指定报刊和 基金管理人公司网 站披露	2011-2-18
3	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分 基金通过交通银行股份有限公司开办定期 定额投资业务以及相关定期定额费率优惠 活动的公告	在中国证券报、上 海证券报和证券时 报三大指定报刊和 基金管理人公司网 站披露	2011-2-19
4	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分 基金通过广发华福证券有限责任公司开办 定期定额投资业务的公告	在中国证券报、上 海证券报和证券时 报三大指定报刊和 基金管理人公司网 站披露	2011-3-7
5	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分 基金通过中国光大银行股份有限公司开通 旗下开放式基金基金转换业务的公告	在中国证券报、上 海证券报和证券时 报三大指定报刊和 基金管理人公司网 站披露	2011-3-7

6	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金通过天相投资顾问有限公司开办定期定额投资业务的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-3-8
7	澄清公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-3-10
8	富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2010年年度报告（正文）	在基金管理人公司网站披露	2011-3-26
9	富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2010年年度报告（摘要）	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-3-26
10	关于与通联支付网络服务有限公司合作开通中国光大银行借记卡、平安银行借记卡、中国工商银行借记卡基金网上交易支付并实施申购费率优惠的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-3-28
11	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金继续参加华夏银行股份有限公司基金定期定额申购费率优惠活动的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-4-1
12	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加华夏银行股份有限公司网上交易基金费率优惠活动的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-4-1
13	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司网上交易基金申购费率优惠活动的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-4-8
14	富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2011年第1号）	在基金管理人公司网站披露	2011-4-14
15	富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金更新招募说明书摘要（2011年第1号）	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-4-14

16	富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2011年第1季度报告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-4-23
17	国海富兰克林基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-5-4
18	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金通过中信证券股份有限公司开通旗下开放式基金基金转换及定期定额投资业务的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-5-30
19	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中信银行股份有限公司网上交易基金申购费率优惠活动的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-6-29
20	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司网上交易基金申购费率优惠活动的公告	在中国证券报、上海证券报和证券时报三大指定报刊和基金管理人公司网站披露	2011-6-30

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金设立的文件
- 2、《富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 4、《富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》
- 5、中国证监会要求的其他文件

### 11.2 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

### 11.3 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](http://www.ftsfund.com) 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司  
二〇一一年八月二十九日