

---

富兰克林国海中证 100 指数增强型分级  
证券投资基金  
之国富 100A 与国富 100B 基金份额上市交易公告书

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

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2015 年 4 月 10 日

公告日期：2015 年 4 月 7 日

---

## 目 录

一、	重要声明与提示.....	2
二、	基金概览.....	2
三、	基金的募集与上市交易.....	4
四、	持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	7
五、	基金主要当事人简介.....	8
六、	基金合同摘要.....	11
七、	基金财务状况.....	11
八、	基金投资组合.....	12
九、	重大事件揭示.....	16
十、	基金管理人承诺.....	16
十一、	基金托管人承诺.....	17
十二、	备查文件目录.....	17
附件：	基金合同内容摘要.....	18

## 一、重要声明与提示

《富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金之国富 100A 与国富 100B 基金份额上市交易公告书》（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，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”）管理人国海富兰克林基金管理有限公司（以下简称“本公司”）的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金之国富 100A 与国富 100B 基金份额上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在 2015 年 2 月 26 日《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》以及本公司网站（www.ftsfund.com）上的《富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金招募说明书》以及同日发布在本公司网站（www.ftsfund.com）上的《富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）。

## 二、基金概览

1、基金名称：富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金

2、基金类别：股票型

3、基金运作方式：契约型、开放式

4、本基金的基金份额包括富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金之基础份额（即“国富中证 100 指数增强分级份额”，以下简称“国富中证 100 份额”，场内简称“国富 100”，基金代码：164508）、富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金之稳健收益类基金份额（即“国富中证 100 指数增强分级 A 份额”，以下简称“国富中证 100 A 份额”，场内简称“国富 100A”，基金代码：150135）与富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金之积极收益类基金份额（即“国富中证 100 指数增强分级 B 份额”，以下简称“国富中证 100 B 份额”场内简称“国富 100B”，基金代码：

150136)。

5、基金存续期限：不定期。

6、国富中证 100A 份额、国富中证 100B 份额与国富中证 100 份额的资产合并运作。

7、本基金通过场内、场外两种方式公开发售。本基金发售结束后，投资者通过场外认购本基金所获得的全部份额将确认为国富中证 100 份额。投资者在场内认购的每 2 份国富中证 100 份额在发售结束后按 1:1 比例自动转换为 1 份国富中证 100A 份额和 1 份国富中证 100B 份额。基金合同生效后，投资者认购所得的国富中证 100 场内份额的自动分离，由基金管理人委托注册登记机构进行，无需基金份额持有人申请。

8、基金合同生效后，国富中证 100 份额（场内简称：国富 100，基金代码：164508）设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。国富中证 100A 份额（场内简称：国富 100A；交易代码：150135）与国富中证 100B 份额（场内简称：国富 100B；交易代码：150136）只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。

9、国富中证 100 份额的申购与赎回：本基金的基金合同生效后的分级运作期内，投资者可选择在场外或场内申购和赎回国富中证 100 份额（场内简称：国富 100，基金代码：164508）。投资者办理国富中证 100 份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且具有场内基金申购赎回资格的深圳证券交易所会员单位。投资者办理国富中证 100 份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和基金管理人委托的场外代销机构。本基金的国富中证 100A 份额与国富中证 100B 份额不接受投资者的申购与赎回。

10、场内份额配对转换：场内份额配对转换是指本基金的国富中证 100 份额与国富中证 100A 份额、国富中证 100B 份额之间的配对转换，包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每两份国富中证 100 份额的场内份额申请转换成一份国富中证 100A 份额和一份国富中证 100B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每一份国富中证 100A 份额和每一份国富中证 100B 份额申请转换成两份国富中证 100 份额的场内份额的行为。

11、基金份额折算：基金份额定期折算的频率为每年折算 1 次。基金份额不定期折算的条件是当国富中证 100 份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元；当国富中证 100B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元。有关基金份额折算的约定，参见基金合同“二十一、分级运作期内基金份额折算”。定期折算基准日或不定期折算基准日的具体日期，详见基金管理人届时发布的公告。

---

12、基金份额总额：截至2015年4月2日，本基金的份额总额为675,455,568.42份；其中，国富中证100份额为439,642,401.42份；国富中证100A份额为117,906,583.00份；国富中证100B份额为117,906,584.00份。

13、基金份额净值：截至2015年4月2日，国富中证100份额的基金份额净值为1.002元，国富中证100A份额的基金份额净值为1.001元，国富中证100B份额的基金份额净值为1.003元。

14、本次上市交易的基金份额场内简称及交易代码：场内份额简称：国富100A，交易代码：150135；场内份额简称：国富100B，交易代码：150136。

15、本次上市交易份额：国富100A：117,906,583.00份；国富100B：117,906,584.00份

16、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

17、上市交易日期：2015年4月10日

18、基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

19、基金托管人：中国银行股份有限公司

20、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

### 三、基金的募集与上市交易

(一) 富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金上市前募集情况

1、本基金发售申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可【2012】426号

2、发售日期：2015年3月2日至2015年3月20日

3、发售面值：1.00元人民币

4、发售方式：场内、场外认购

---

## 5、发售机构：

### （1）场内发售机构

场内销售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。

### （2）场外发售机构

本基金的场外销售机构包括直销机构和代销机构。其中直销机构是指国海富兰克林基金管理有限公司（以下简称“本公司”），代销机构包括：中国银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、国海证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、东北证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、中信证券（浙江）有限责任公司、安信证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、上海证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、江海证券有限公司、东海证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、上海华信证券有限责任公司、中信证券（山东）有限责任公司、中航证券有限公司、华福证券有限责任公司、上海天天基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、万银财富(北京)基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司（排名不分先后）。

## 6、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

## 7、认购资金总额及入账情况：

本次富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金募集的有效认购户数为5,912户，净销售金额为人民币675,295,672.74元，认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币159,895.68元。

上述资金中，场内首次发行募集资金为人民币235,813,167.00元，场外首次发行募集资金为人民币439,642,401.42元，分别于2015年3月25日全额划入本基金通过基金托管人中国银行股份有限公司开立的富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金托管专户。

按照每份基金份额初始面值1.00元计算，本次募集期的募集资金及其利息结转的份额共计675,455,568.42份，已全部计入基金份额持有人基金账户，归基金份额持有人所有。其中，募集期间基金管理人的从业人员认购本基金151,493.64份，占基金总份额比例为

0.02%；本公司运用自有资金认购本基金 0.00 份，占基金总份额比例0.00 %；本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人认购本基金份额总量的数量区间为0万份至10万份（含）。

#### 8、基金备案情况

本基金于2015年3月26日验资完毕，2015年3月26日向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于 2015年3月26日获得书面确认，本基金基金合同自该日起正式生效。

9、基金合同生效日：2015年3月26日。

10、本基金总份额：675,455,568.42 份。

（二）富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金份额上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上[2015]122号

2、上市交易日期：2015年4月10日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

4、场内份额简称：国富100A，交易代码：150135；场内份额简称：国富100B，交易代码：150136

6、本次上市交易份额：国富100A：117,906,583.00 份；国富100B：117,906,584.00份（截至2015年4月2日）

7、基金资产净值的披露：每个工作日的次日公布国富100的基金份额净值、国富100A、国富100B的基金份额参考净值，并在深交所行情发布系统揭示。

8、未上市交易份额的流通规定：对于托管在场内的的国富中证100份额，基金份额持有人可以直接申请场内赎回但不在深圳证券交易所上市交易，在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为国富中证100份额A份额和国富中证100B份额即可上市流通；对于托管在场外的份额，基金份额持有人既可直接申请场外赎回，也可在办理跨系统转托管后通过跨系统转托管转至深圳证券交易所场内后分拆为国富中证100份额A份额和国富中证100B份额即

可上市流通。

#### 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

##### （一）持有人户数

截至2015年4月2日，富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金的持有人总户数为5,911户，其中场外持有人总户数为5,066户；国富中证100A份额持有人总户数为845户，全部为场内持有人；国富中证100B份额持有人总户数为845户，全部为场内持有人；国富中证100份额平均每户持有的场外基金份额为86,782.95份，国富中证100A平均每户持有的场内基金份额为139,534.42份，国富中证100B平均每户持有的场内基金份额为139,534.42份。

##### （二）持有人结构

1、截至2015年4月2日，场内基金份额持有人结构如下：

国富100A：场内机构投资者持有的基金份额 32,470,329.00份，占比 27.54%；场内个人投资者持有的基金份额 85,436,254.00 份，占比72.46%。

国富100B：场内机构投资者持有的基金份额32,470,335.00份，占比 27.54%；场内个人投资者持有的基金份额 85,436,249.00份，占比72.46%。

2、截至2015年4月2日，基金管理人的从业人员持有本基金的情况如下：

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例(%)
基金管理公司	国富中证100份额	101,493.64	0.02%
所有从业人员	国富100A	25,000.00	0.02%
持有本基金	国富100B	25,000.00	0.02%
	合计	151,493.64	0.02%

截至2015年4月2日，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0万份至10万份（含）；本基金的基金经理未持有本基金。

##### （三）截至2015年4月2日，国富100A 基金份额前十名持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占场内基金总份额的比例(%)
1	中国银河证券股份有限公司	10,000,194.00	8.48%
2	兴业证券股份有限公司	8,500,165.00	7.21%
3	招商证券股份有限公司	7,500,145.00	6.36%
4	顾云彪	6,001,108.00	5.09%
5	孙全英	5,000,924.00	4.24%

6	中信证券股份有限公司	5,000,243.00	4.24%
7	何怡	2,500,462.00	2.12%
8	张银海	2,500,292.00	2.12%
9	张建勃	2,500,146.00	2.12%
10	陈蓉微	1,500,277.00	1.27%
11	许友琴	1,500,277.00	1.27%

截至2015年4月2日，场内国富100B基金份额前十名持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有份额	占场内基金总份额的比例 (%)
1	中国银河证券股份有限公司	10,000,194.00	8.48%
2	兴业证券股份有限公司	8,500,165.00	7.21%
3	招商证券股份有限公司	7,500,146.00	6.36%
4	顾云彪	6,001,108.00	5.09%
5	孙全英	5,000,923.00	4.24%
6	中信证券股份有限公司	5,000,243.00	4.24%
7	何怡	2,500,461.00	2.12%
8	张银海	2,500,291.00	2.12%
9	张建勃	2,500,145.00	2.12%
10	陈蓉微	1,500,277.00	1.27%
11	许友琴	1,500,277.00	1.27%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

#### 1、基本情况

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：上海浦东新区世纪大道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

电话：021-3855 5555

传真：021-6887 0708

联系人：沈增

注册资本：2.2 亿元人民币

股权结构（截止于2015年4月2日）：

股东名称	出资比例（%）
国海证券股份有限公司	51%
邓普顿国际股份有限公司	49%

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会讨论与投资相关的事务，并对重大投资决策做出决定。风险控制委员会行使制订公司的业务风险管理政策和组织实施方案等职权。

公司目前下设15个部门、三个分公司和一个子公司，分别是投资管理部、资产管理部、研究分析部、中央交易室、金融工程部、风险控制部、业务发展部、机构业务部、零售业务部、基金市场部、客户服务部、基金事务部、信息技术部、监察稽核部、行政管理部、上海分公司、深圳分公司、北京分公司、国海富兰克林资产管理（上海）有限公司。投资管理部主要负责基金资产的具体投资运作；资产管理部主要负责公司专户理财的投资业务，协助挖掘潜在客户并进行具体的帐户投资管理业务，以完成客户的投资目标；研究分析部是公司的基础研究部门，主要负责收集、分析各类政治、经济与行业信息，研究宏观经济、资本市场、行业及上市公司的情况，为基金的投资决策提供建议和依据；中央交易室是公司投资决策的執行和監督部門；金融工程部是公司投資研究體系下，負責指數及其他量化產品的投研工作的職能部門；風險控制部是負責公司旗下基金和其他資產管理產品或計劃的投資風險管理和控制的職能部門；業務發展部是負責公司發展戰略研究、業務開拓、產品研發管理的業務部門；機構業務部是負責機構客戶的開發、維護和服務的業務部門；零售業務部是從事渠道銷售支持的業務部門；基金市場部是負責從事市場推廣、品牌建設、對外交流、網站規劃、電子商務的職能部門；客戶服務部是從事客戶服務的業務部門；基金事務部包括注冊登記小組、資金清算和基金核算小組兩個業務小組；信息技術部是為保障公司日常經營正常運轉提供信息系統支持的職能部門；監察稽核部是公司內部行使監察稽核職能的部門，獨立於所有的業務部門，直接對董事會負責，向中國證監會和董事會報告，在業務上接受督察長的指導；行政管理部全面負責公司的行政後勤、人力資源、財務、自有資產管理等工作；上海分公司主要負責華東地區的渠道銷售，維護客戶等職能；深圳分公司主要負責華南地區的渠道銷售，維護客戶等職能；北京分公司主要負責北方地區的渠道銷售，維護客戶等職能；國海富蘭克林資產管理（上海）有限公司經營特定客戶資產管理以及中國證監會認可的其他業務。

截止到2015年4月2日，公司有員工125人，其中46%以上具有碩士以上學歷。

### 3、本基金基金經理

張志強先生，CFA，紐約州立大學（布法羅）計算機科學碩士，中國科學技術大學數學專業碩士。歷任美國Enreach Technology Inc. 軟件工程師，海通證券股份有限公司研

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指数增强基金经理、国富中证100指数增强型分级基金基金经理、职工监事。

## （二）基金托管人

### 1、基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

成立日期：1983年10月31日

批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

存续期间：持续经营

联系电话：95566

传真：010-66594942

联系人：王永民

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。

### 2、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。

### 3、基金托管业务经营情况

截至2014年12月31日，中国银行已托管307只证券投资基金，其中境内基金282只，QDII基金25只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，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。

(三) 基金验资机构

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：上海湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：杨绍信

经办注册会计师：单峰、沈兆杰

联系人：沈兆杰

电话：021-6123 8888

传真：021-6123 8800

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用，其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金2015年4月2日资产负债表如下：  
(除特别注明外，金额单位为人民币元)

资 产	本期末 2015年4月2日
<b>资 产：</b>	
银行存款	134,607,422.48
结算备付金	7,188,988.05
存出保证金	519,695.93
交易性金融资产	534,974,489.70
其中：股票投资	534,974,489.70
基金投资	—
债券投资	—
资产支持证券投资	—
贵金属投资	—
衍生金融资产	—
买入返售金融资产	—

应收证券清算款	—
应收利息	77,884.44
应收股利	—
应收申购款	—
递延所得税资产	—
其他资产	7,904.98
资产总计	677,376,385.58
<b>负债和所有者权益</b>	本期末 2015年4月2日
<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	—
应付管理人报酬	37,019.44
应付托管费	8,144.27
应付销售服务费	—
应付交易费用	482,804.38
应交税费	—
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	60,186.47
负债合计	588,154.56
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	675,455,568.42
未分配利润	1,332,662.60
所有者权益合计	676,788,231.02
负债和所有者权益总计	677,376,385.58

## 八、基金投资组合

截至2015年4月2日，富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金的投资组合如下：

### （一） 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	534,974,489.70	78.98
	其中：股票	534,974,489.70	78.98
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	—	—
	买入返售金融资产	—	—
6	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	141,796,410.53	20.93
8	其他资产	605,485.35	0.09
9	合计	677,376,385.58	100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：截至2015年4月2日，本基金未持有积极投资股票。

2、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	22,923,689.00	3.39
C	制造业	138,786,957.73	20.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,695,891.56	1.88
E	建筑业	32,160,748.00	4.75
F	批发和零售业	5,408,529.60	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	11,177,564.00	1.65
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,434,284.00	0.95
J	金融业	283,095,938.58	41.83
K	房地产业	19,602,439.23	2.90
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	2,688,448.00	0.40
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	534,974,489.70	79.05

(三) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

1、报告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	463,900	36,193,478.00	5.35
2	600016	民生银行	2,588,800	25,033,696.00	3.70
3	600036	招商银行	1,576,170	24,682,822.20	3.65
4	600030	中信证券	706,601	23,628,737.44	3.49
5	601166	兴业银行	1,091,700	19,781,604.00	2.92
6	600837	海通证券	726,400	17,833,120.00	2.64
7	600000	浦发银行	1,069,000	17,296,420.00	2.56
8	000002	万科A	753,200	10,235,988.00	1.51
9	601668	中国建筑	1,346,400	10,124,928.00	1.50
10	601601	中国太保	282,200	9,597,622.00	1.42

2、报告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

注：截至2015年4月2日，本基金未持有积极投资股票。

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：截至2015年4月2日，本基金本报告期末未持有债券。

(五) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：截至2015年4月2日，本基金未持有债券。

(六) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资  
 明细

注：截至2015年4月2日，本基金未持有资产支持证券。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细  
注：截至2015年4月2日，本基金未持有权证。

（八）投资组合报告附注

1、申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）于2015年1月19日公告因存在为到期融资融券合约展期的问题（根据相关规定，融资融券合约期限最长为6个月），被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。对此，中信证券已采取以下整改措施：1、暂停新开融资融券客户信用账户3个月；2、自2015年1月16日起，中信证券将不允许新增任何新的合约逾期，距合约到期两周前将反复提醒客户及时了结合约，对于到期未了结的合约将强制平仓；3、在监管规定的时间内，清理完成旧的逾期合约；4、将融资融券业务客户开户条件由客户资产满人民币30万元提高到客户资产满人民币50万元。

本基金对中信证券投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究，认为上述事件仅对中信证券短期经营有一定影响，不改公司长期投资价值。同时由于我们看好证券行业整体的发展前景向好，行业杠杆度的提升带来盈利能力的上升，因此买入中信证券。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。

海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）于2015年1月20日公告2015年1月16日中国证监会公开通报2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况。海通证券因存在违规为到期融资融券合约展期问题，受到暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。经查，海通证券存在为少数融资融券六个月到期并提出逾期负债暂缓平仓申请的客户，在维持担保比例处于150%以上的前提下暂缓平仓的行为，这部分客户数占海通证券融资融券交易的总客户数不到1%。目前海通证券已经采取了以下整改措施：一是暂停新开客户信用账户三个月；二是不允许有任何新的合约逾期，合约到期前将按合同规定提醒客户及时了结合约，到期未了结将会执行强制平仓；三是按监管要求限定的期限内完成违规逾期合约的清理；四是认真整改融资融券业务，确保业务的合规经营。

本基金对海通证券投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究，认为上述事件仅对海通证券短期经营有一定影响，不改公司长期投资价值。同时由于我们看好证券行业整体的发展前景向好，行业杠杆度的提升带来盈利能力的上升，因此买入海通证券。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。

2、申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

截至2015年4月2日，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	519,695.93
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	77,884.44
5	应收申购款	—
6	其他应收款	7,904.98
7	待摊费用	—
8	其他	—
	合计	605,485.35

### 4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：截至2015年4月2日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

### 5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### (1) 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：截至2015年4月2日，本基金持有的指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### (2) 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：截至2015年4月2日，本基金未持有积极投资股票。

## 九、重大事件揭示

本基金自基金合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

## 十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

(一) 严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二) 真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

---

(三) 在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后, 将及时予以公开澄清。

## 十一、 基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:

(一) 严格遵守《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定, 以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

(二) 根据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定, 对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查。如发现基金管理人违反《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定, 将及时通知基金管理人纠正; 基金管理人  
对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的, 基金托管人将及时向中国证监会报告。

## 十二、 备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所, 投资者可在办公时间免费查阅。

- (一) 中国证监会核准基金募集的文件
- (二) 《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同》
- (三) 《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金招募说明书》
- (四) 《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金托管协议》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照

国海富兰克林基金管理有限公司

2015年4月7日

## 附件：基金合同内容摘要

### （一）基金合同当事人及其权利义务

#### 1、基金管理人基本情况

名称：国海富兰克林基金管理有限公司

住所：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

法定代表人：吴显玲

成立日期：2004年11月15日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]145号

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：2.2亿元人民币

存续期间：50年

#### 2、基金管理人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- （1）依法募集基金；
- （2）自本基金合同生效之日起，根据法律法规和本基金合同独立运用并管理基金财产；
- （3）依照本基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）召集基金份额持有人大会；
- （6）依据本基金合同及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据本基金合同及有关法律决定基金收益的分配方案；
- (11) 在本基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
- (16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；
- (17) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

### 3、基金管理人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- (2) 办理基金备案手续；
- (3) 自本基金合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (6) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 依法接受基金托管人的监督；
- (8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合本

基金合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

(11) 严格按照《基金法》、本基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、本基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按本基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照本基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反本基金合同导致基金财产损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和本基金合同规定履行自己的义务，基金托管人违反本基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金管理人募集期间未能达到基金的备案条件，本基金合同不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和本基金合同约定的其他义务。

#### 4、基金托管人基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

成立日期：1983年10月31日

批准设立机关和批准设立文号：国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》（国发[1979]72号）

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

存续期间：持续经营

#### 5、基金托管人的权利

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

- (1) 自本基金合同生效之日起，依法律法规和本基金合同的规定安全保管基金财产；
- (2) 依本基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反本基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规和本基金合同规定的其他权利。

#### 6、基金托管人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (4) 除依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照本基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、本基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；
- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- (10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照本基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行本基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照法律法规和本基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；
- (17) 参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反本基金合同导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 按规定监督基金管理人按法律法规和本基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反本基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- (22) 法律法规和本基金合同规定的其他义务。

## 7、基金份额持有人的权利

投资者购买本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。分级运作期内，国富中证 100 份额、国富中证 100 A 份额、国富中证 100 B 份额持有人持有的每一份基金份额按基金合同约定仅在其份额类别内拥有同等的权益；分级运作期结束后，每一份富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）份额拥有同等的权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规和本基金合同规定的其他权利。

## 8、基金份额持有人的义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- （1）认真阅读并遵守本基金合同；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自行承担投资风险；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）缴纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和本基金合同所规定的费用；
- （5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者本基金合同终止的有限责任；
- （6）不从事任何有损基金及其他本基金合同当事人合法权益的活动；
- （7）执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- （8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和本基金合同约定的其他义务。

## (二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人组成。基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。分级运作期内，国富中证 100 份额、国富中证 100 A 份额、国富中证 100 B 份额的基金份额持有人持有的每一份基金份额按基金合同约定仅在其份额类别内拥有同等的权益；分级运作期结束后，每一份富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）份额拥有同等的权益。

### 2、召集方式：

(1) 除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

(2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

(3) 单独或合计持有本基金份额（分级运作期内指单独或合计持有国富中证 100 份额、国富中证 100 A 份额、国富中证 100 B 份额各自份额）10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计持有本基金份额（分级运作期内指单独或合计持有国富中证 100 份额、国富中证 100 A 份额、国富中证 100 B 份额各自份额）10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

(4) 单独或合计持有本基金份额（分级运作期内指单独或合计持有国富中证 100 份额、国富中证 100 A 份额、国富中证 100 B 份额各自份额）10%以上的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计持有本基金份额（分级运作期内指单独或合计持有国富中证 100 份额、国富中证 100 A 份额、国富中证 100 B 份额各自份额）10%以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

(5) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

(6) 基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

### 3、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

(1) 会议召开的时间、地点和会议形式；

(2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

(3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

(4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

(5) 会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(7) 召集人需要通知的其他事项。

4、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

5、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

### 6、开会方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会以及法律法规和监管机

关允许的其他方式。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力；通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定。

现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、本基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的本基金份额不少于在权益登记日基金总份额的 50%（分级运作期内指单独或合计持有国富中证 100 份额、国富中证 100 A 份额、国富中证 100 B 份额各自份额均不少于各自类别总份额的 50%）。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的本基金份额不少于在权益登记日基金总份额的 50%（分级运作期内指单独或合计持有国富中证 100 份额、国富中证 100 A 份额、国富中证 100 B 份额各自份额均不少于各自类别总份额的 50%）；

(4) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符；

(5) 会议通知公布前已报中国证监会备案。

如果开会条件达不到上述的条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在 25 个工作日后），且确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日应保持不变。

在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

## 7、议事程序

在现场开会的方式下，首先由召集人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议，报经中国证监会核准或备案后生效。在通讯表决开会的方式下，首先由召集人在会议通知中公布提案，在所通知的表决截止日期第二个工作日由大会聘请的公证机关的公证员统计全部有效表决并形成决议，报经中国证监会核准或备案后生效。

## 8、表决

(1) 国富中证 100 份额、国富中证 100 A 份额、国富中证 100 B 份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### A. 特别决议

对于特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过（分级运作期内需经参加大会的国富中证 100 份额、国富中证 100 A 份额、国富中证 100 B 份额的各自份额三分之二以上通过）。

更换基金管理人或者基金托管人、转换基金运作方式或终止基金合同应当以特别决议通过方为有效。

### B. 一般决议

对于一般决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过（分级运作期内需经参加大会的国富中证 100 份额、国富中证 100 A 份额、国富中证 100 B 份额各自份额 50%以上通过）。

除上述(1)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，符合法律法规、基金合同和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面

意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 9、计票

### (1) 现场开会

1) 基金份额持有人大会的主持人为召集人授权出席大会的代表，如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员(如果基金管理人为召集人，则监督员由基金托管人担任；如基金托管人为召集人，则监督员由基金托管人在出席会议的基金份额持有人中指定)共同担任监票人；如大会由单独或合计持有本基金份额（分级运作期内指单独或合计持有国富中证 100 份额、国富中证 100 A 份额、国富中证 100 B 份额各自份额）10%以上的基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中推举三名基金份额持有人代表担任监票人。

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

3) 如果大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或者基金份额持有人代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。重新清点后，大会持有人应当场公布重新清点结果。

4) 在基金管理人或基金托管人担任召集人的情形下，如果在计票过程中基金管理人或者基金托管人拒不配合的，则参加会议的基金份额持有人有权推举三名基金份额持有人代表共同担任监票人进行计票。

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式可采取如下方式：

由大会召集人授权的两名监票人在监督人（若基金管理人为召集人，监督人为托管人；

若基金托管人为召集人，监督人为基金管理人）派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权 3 名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## 10、生效与公告

（1）基金份额持有人大会按照《基金法》有关法律法规规定表决通过的事项，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

（2）生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有法律约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决定。

（3）基金份额持有人大会决议应当自中国证监会核准或出具无异议意见后 2 日内，由基金份额持有人大会召集人在至少一种指定媒体上公告。

（4）如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机关、公证员姓名等一同公告。

### （三）基金收益分配原则

#### 1、五年分级运作期内的基金收益分配原则

在本基金分级运作期内，本基金（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）不进行收益分配。

#### 2、分级运作期届满，本基金转型为富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）后的收益分配原则

##### （1）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

##### （2）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

##### （3）基金收益分配原则

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。

2) 对于登记在基金份额持有人注册登记系统中的基金账户下的份额, 本基金收益分配方式分两种: 现金分红与红利再投资, 投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资; 若投资者不选择, 本基金默认的收益分配方式是现金分红。对于登记在基金份额持有人在证券登记结算系统中的深圳证券账户下的份额, 其分红方式仅为现金红利一种。

3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值; 即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4) 每一基金份额享有同等分配权。

5) 法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定。

### 3、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### 4、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定, 并由基金托管人复核, 在 2 个工作日内在指定媒体公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过 15 个工作日。

#### 5、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额, 不足于支付银行转账或其他手续费用时, 基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法, 依照《业务规则》执行。

### (四) 与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

#### 1、基金管理人的管理费

在分级运作期内, 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, 基金管理费调整为按前一日基金资产净值的 0.85% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

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：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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：

$$H = E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$$

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。

## （五）基金财产的投资方向和投资限制

### 1、投资目标

本基金为股票指数增强型基金。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%。

### 2、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。

### 3、投资限制

(1) 为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- a) 承销证券；
- b) 向他人贷款或者提供担保；
- c) 从事承担无限责任的投资；
- d) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- e) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- f) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

- g) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- h) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
- i) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## (2) 基金投资组合比例限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- a) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过本基金资产净值的 10%；
- b) 本基金进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- c) 本基金参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- d) 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%，其中投资于股票的资产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%；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；
- e) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；
- f) 本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；
- g) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金管理人应当按照中国金融期货交易所要求的内容、格式与时限向交易所报告所交易和持有的卖出期货合约情况、交易目的及对应的证券资产情况等；
- h) 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；
- i) 本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证 10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定。
- j) 法律法规规定的其他比例限制。

法律法规或监管部门对上述比例另有规定的，从其规定；如果法律法规或监管部门取消上述限制性规定，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。因证券期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定时，从其规定。

#### （六）基金资产净值的计算方法和公告公式

分级运作期内，本基金按照国富中证 100 A 份额和国富中证 100 B 份额的参考净值计算规则依据下列公式分别计算并公告国富中证 100 份额净值、国富中证 100 A 份额参考净值和国富中证 100 B 份额的参考净值。分级运作期结束后本基金转型的富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）的净值计算公式与国富中证 100 份额相同。

##### 1. 国富中证 100 份额的基金份额净值计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

T 日国富中证 100 份额的基金份额净值 = T 日闭市后的基金资产净值 / T 日本基金基金份额的总数

国富中证 100 份额的基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。T 日国富中证 100 份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

分级运作期内，T 日本基金基金份额的总数为国富中证 100 份额、国富中证 100 A 份额和国富中证 100 B 份额的份额数之和。

##### 2. 国富中证 100 A 份额和国富中证 100 B 份额的基金份额参考净值计算

$$NAV_{\text{国富中证100A}} = 1 + R \times \frac{t}{\text{当年实际天数}}$$

$$NAV_{\text{国富中证100B}} = \frac{NAV_{\text{国富中证100}} - 0.5 * NAV_{\text{国富中证100A}}}{0.5}$$

设 T 日为基金份额净值计算日，T=1, 2, 3……N；N 为当年实际天数；t=min{自年初至 T 日，自基金合同生效日至 T 日，自最近一次会计年度内份额折算日至 T 日}；

$NAV_{\text{国富中证100}}$  为 T 日每份国富中证 100 份额的基金份额净值； $NAV_{\text{国富中证100A}}$  为 T 日国富中证 100 A 份额的基金份额参考净值； $NAV_{\text{国富中证100B}}$  为 T 日国富中证 100 B 份额的基金份额参考净值；R 为国富中证 100 A 份额约定年收益率。

国富中证 100 A 份额和国富中证 100 B 份额的基金份额参考净值的计算，均保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。

T 日国富中证 100 A 份额和国富中证 100 B 份额的基金份额参考净值在当天收市后计算，并在 T+1 日公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

本基金合同生效后，在开始办理国富中证 100 份额的申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金财产净值和国富中证 100 份额净值、国富中证 100 A 份额参考净值和国富中证 100 B 份额参考净值。

在开始办理国富中证 100 份额的申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放日的国富中证 100 份额的基金份额净值及基金份额累计净值、国富中证 100 A 份额和国富中证 100 B 份额的各自基金份额参考净值及基金份额累计参考净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金财产净值、国富中证 100 份额净值、国富中证 100 A 份额参考净值和国富中证 100 B 份额参考净值。基金管理人应当在前述最后一个市场交易日的次日，将基金财产净值、国富中证 100 份额的基金份额净值及基金份额累计净值、国富中证 100 A 份额和国富中证 100 B 份额各自的基金份额参考净值及基金份额累计参考净值登载在指定报刊和网站上。

#### （七）基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、有下列情形之一的，在履行相关的程序后，本基金合同应当终止：

- （1）基金份额持有人大会决定终止；
- （2）基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、基金托管人承接的；
- （3）法律法规和基金合同规定的其他情形。

#### 2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止情形发生之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算

组可以依法进行必要的民事活动。

### 3、清算程序

- (1) 基金合同终止情形发生后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- (3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行评估和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 对基金财产进行分配。

### 4、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

### 5、基金剩余财产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

对于基金缴存于中国证券登记结算有限责任公司的最低结算备付金和交易席位保证金等，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整后方可收回。

### 6、基金财产清算剩余资产的分配

如基金合同于分级运作期内终止，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算国富中证 100 份额、国富中证 100 A 份额、国富中证 100 B 份额各自的应计分配比例，并据此由国富中证 100 份额、国富中证 100 A 份额、国富中证 100 B 份额各自的基金份额持有人根据其所持的基金份额比例进行分配。

如基金合同于分级运作期结束本基金转为 LOF 后终止，依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务

后，按照基金份额持有人所持的基金份额比例进行分配。

#### 7、基金财产清算的公告

基金财产清算组做出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

#### 8、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### （八）争议解决方式

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

#### （九）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人和基金托管人住所，投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。