

**富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2015年半年度报告**

**2015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**

**送出日期：2015年8月28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2015年8月26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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。



10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63	域代码已更改
10.4 基金投资策略的改变.....	63	域代码已更改
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63	域代码已更改
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.....	63	域代码已更改
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64	域代码已更改
10.8 其他重大事件.....	66	域代码已更改
§11 备查文件目录.....	68	域代码已更改
11.1 备查文件目录.....	68	域代码已更改
11.2 存放地点.....	68	域代码已更改
11.3 查阅方式.....	68	域代码已更改

## § 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
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	190,886,074.80份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	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%。
投资策略	<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</p>

	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。
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	储丽莉
	联系电话	021-3855 5555
	电子邮箱	service@ftsfund.com
客户服务电话	400-700-4518、9510-5680和 021-38789555	95599
传真	021-6888 3050	010-68121816
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	北京东城区建国门内大街69 号
办公地址	上海市浦东新区世纪大道8号 上海国金中心二期9层	北京复兴门内大街28号凯晨 世贸中心东座9层
邮政编码	200120	100031
法定代表人	吴显玲	刘士余

### 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	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期9层

**§ 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

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	报告期（2015年1月1日至2015年6月30日）
本期已实现收益	220,596,491.64
本期利润	113,558,319.85
加权平均基金份额本期利润	0.3399
本期加权平均净值利润率	23.41%
本期基金份额净值增长率	26.11%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	118,945,289.56
期末可供分配基金份额利润	0.6231
期末基金资产净值	309,831,364.36
期末基金份额净值	1.623
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	62.30%

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	份额净	业绩比	业绩比	①-③	②-④
----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

	值增长率①	值增长率标准差②	较基准收益率③	较基准收益率标准差④		
过去一个月	-7.78%	3.33%	-7.17%	3.32%	-0.61%	0.01%
过去三个月	10.71%	2.50%	9.99%	2.48%	0.72%	0.02%
过去六个月	26.11%	2.16%	25.30%	2.15%	0.81%	0.01%
过去一年	97.69%	1.73%	99.71%	1.75%	-2.02%	-0.02%
过去三年	81.34%	1.41%	77.25%	1.42%	4.09%	-0.01%
自基金合同生效日起至今（2009年09月03日-2015年06月30日）	62.30%	1.38%	52.85%	1.41%	9.45%	-0.03%

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<sub>t</sub>）按下列公式计算：

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

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



注：本基金的基金合同生效日为2009年9月3日，本基金在建仓期结束时，各项投资比例符合基金合同约定。

## § 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，由国海证券股份有限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，目前公司注册资本2.2亿元人民币，国海证券股份有限公司持有51%的股份，邓普顿国际股份有限公司持有49%的股份。

国海证券股份有限公司是国内A股市场第16家上市券商，是拥有全业务牌照，营业网点遍布中国主要城市的全国性综合类证券公司。富兰克林邓普顿投资集团是世界知名基金管理公司，在全球市场上有超过65年的投资管理经验。国海富兰克林基金管理有限公司引进富兰克林邓普顿投资集团享誉全球的投资机制、研究平台和风险控制体系，借助国海证券股份有限公司的综合业务优势，力争成为国内一流的基金管理公司。

本公司具有丰富的管理基金经验。自2005年6月第一只基金成立开始，截至本报告期末，本公司已经成功管理了20只基金产品（包含A、C类混合基金，A、B、C类债券基金，A、B类货币市场基金）。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
张志强	公司量化与指数投资总监，金融工程部总经理，职工监事，国富沪深300指数增强基金及国富中证	2013年3月21日	—	12年	张志强先生，CFA，纽约州立大学（布法罗）计算机科学硕士，中国科学技术大学数学专业硕士。历任美国Enreach Technology Inc.软件工程师，海通证券股份有限公司研究所高级研究员，友邦华泰基金管理有限公司高级数量分析师，国海富兰克林基金管理有限公司首席数量分析师、风险控制部总经理、业务发展部

	100指数增强分级基金基金经理				总经理。截止本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司量化与指数投资总监、金融工程部总经理、国富沪深300指数增强基金及国富中证100指数增强分级基金基金经理、职工监事。
--	-----------------	--	--	--	--

注：

1. 表中“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，其中，首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日。
2. 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遵规守信情况的说明

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，公司在研究报告发布公平性、投资决策独立性、交易公平分配，信息隔离等方面均能严格执行《公平交易管理制度》，严格按照制度要求对异常交易进行控制和审批。

报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格按照《异常交易监控与报告制度》和《同日反向交易管理办法》对异常交易进行监控。报告期内公司不存在投资组合之间发生的同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

#### 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

2015年上半年，A股市场持续大幅上涨，直至6月中旬迎来一轮急剧下跌，其中沪深

300指数上涨26.58%，以创业板股票为代表的新经济等主题股票的涨幅远超大盘蓝筹股。从宏观经济来看，上半年PMI指数缓慢上升，经济呈现低位企稳迹象，但工业景气度仍旧低迷。投资上，固定资产投资增速继续放缓，虽然房地产销售有所反弹，但房地产投资增长继续下滑。消费保持缓慢增长，短期没有显著改观。进出口数据也停留在历史低位。在经济低迷的情况下，各项政策总体宽松，股票市场的资金供给充裕是促使市场大幅上涨的主要因素之一。在市场大幅上涨的同时，各种非理性投机行为充斥市场，成为6月中旬市场暴跌的主因。

投资策略上，本基金在保持均衡的组合配置以控制主动投资风险的基础上，重点通过个股选择和事件性策略争取超越业绩比较基准的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日，本基金份额净值为1.623元。本报告期，基金份额净值上涨26.11%，同期业绩比较基准上涨25.30%，基金表现超越业绩比较基准0.81%，年化跟踪误差为1.45%。

#### 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2015年下半年，经济增长继续放缓的压力仍然存在，在保持宽松货币政策的情况下，为避免陷入流动性陷阱，预计将有更加积极的财政政策，放松房地产调控、地方债务置换、中央加速审批大项目都是政府可能采取的举措。但是问题的关键仍然是如何激活经济活力，逐步推进有利于调整经济增长方式、释放潜在经济活力的各项重大改革措施。

一方面经济复苏的不确定性仍然较大，另一方面6月中旬以来市场大幅下跌以及政府救市行为对于投资者和股票市场的损伤，预计股票市场短期之内仍然比较脆弱，后续需要看救市资金的退出情况和市场监管机制正常化的进度。投资策略方面，本基金下半年仍将保持均衡配置，控制主动投资风险。同时，力争通过选股和其它有效策略获取超额收益。

#### 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。公司估值委员会由董事长（本报告期内代为履行总经理职责）或其任命者负责，成员包括投研、风险控制、监察稽核、交易、基金核算方面的部门主管，相关人员均具有丰富的证

券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，应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

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施分配的利润。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 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

在托管本基金的过程中，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》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国海富兰克林基金管理有限公司 2015年1月1日至2015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本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，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本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，未发现有关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：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	15,005,988.22	38,329,228.54
结算备付金		144,658.09	994,639.30
存出保证金		194,635.94	34,035.51
交易性金融资产	6.4.7.2	292,874,651.16	726,027,562.49
其中：股票投资		292,874,651.16	725,845,398.29
基金投资		—	—
债券投资		—	182,164.20
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
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		8,749,112.78	13,961,453.63
应收利息	6.4.7.5	3,736.61	8,426.61
应收股利		—	—
应收申购款		1,598,460.79	1,864,287.45
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		318,571,243.59	781,219,633.53
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 2014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	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		7,938,832.17	11,022,253.17
应付管理人报酬		260,161.40	528,400.11
应付托管费		45,910.84	93,247.06
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	272,512.76	684,299.45
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	222,462.06	408,786.51
负债合计		8,739,879.23	12,736,986.30
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	190,886,074.80	597,179,532.42
未分配利润	6.4.7.10	118,945,289.56	171,303,114.81
所有者权益合计		309,831,364.36	768,482,647.23
负债和所有者权益总计		318,571,243.59	781,219,633.53

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.623元，基金份额总额190,886,074.80份。

## 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：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
<b>一、收入</b>		118,191,415.52	-28,319,910.84
1.利息收入		113,611.52	110,320.00
其中：存款利息收入	6.4.7.11	113,598.72	110,264.75

## 富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2015年半年度报告

债券利息收入		12.80	55.25
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		—	—
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		224,625,398.17	-62,727,974.55
其中：股票投资收益	6.4.7.12	222,158,559.53	-67,670,628.52
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	61,118.40	18,337.95
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7.14	—	—
股利收益	6.4.7.15	2,405,720.24	4,924,316.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-107,038,171.79	34,278,284.75
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	490,577.62	19,458.96
<b>减：二、费用</b>		4,633,095.67	4,981,595.09
1. 管理人报酬		2,045,233.04	2,166,386.99
2. 托管费		360,923.47	382,303.49
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7.18	1,943,613.97	2,133,560.14
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	6.4.7.19	283,325.19	299,344.47
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”</b>		113,558,319.85	-33,301,505.93

号填列)			
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		113,558,319.85	-33,301,505.93

### 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：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015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)	597,179,532.42	171,303,114.81	768,482,647.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	113,558,319.85	113,558,319.85
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)	-406,293,457.62	-165,916,145.10	-572,209,602.72
其中：1.基金申购款	81,066,762.50	41,200,681.23	122,267,443.73
2.基金赎回款	-487,360,220.12	-207,116,826.33	-694,477,046.45
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)	190,886,074.80	118,945,289.56	309,831,364.36
项 目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	647,643,495.63	-82,086,421.75	565,557,073.88

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-33,301,505.93	-33,301,505.93
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)	-41,966,871.92	7,262,397.42	-34,704,474.50
其中：1.基金申购款	26,862,140.26	-4,745,121.21	22,117,019.05
2.基金赎回款	-68,829,012.18	12,007,518.63	-56,821,493.55
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)	605,676,623.71	-108,125,530.26	497,551,093.45

报表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：

吴显玲（董事长，本报告期内  
代为履行总经理职责）

胡昕彦

黄宇虹

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 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。本基金投资于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%。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： $95\% \times \text{沪深300指数} + 5\% \times \text{银行同业存款利率}$ 。

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2015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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 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2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

##### 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2015年1月1日至2015年6月30日。比较会计报表的实际编制期间为2014年1月1日至2014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

##### (1) 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。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、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公允价值变动计入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其他各类应收款项等。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。

##### (2) 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其他各类应付款项等。

#### 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，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；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，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。

对于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；对于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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 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:

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 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或者发行价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；于处置时，其处置价格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则按直线法计算。

#### 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则按直线法计算。

#### 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权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为正数，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，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，即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权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组

成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会字[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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 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。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起, 对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在1个月以内(含1个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在1个月以上至1年(含1年)的, 暂减按50%计入应纳税所得额; 持股期限超过1年的, 暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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 2015年6月30日
活期存款	15,005,988.22
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	15,005,988.22

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	209,284,285.52	292,874,651.16	83,590,365.64
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
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	209,284,285.52	292,874,651.16	83,590,365.64

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

##### 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**

无余额。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

无余额。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	3,599.27
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	58.59
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	78.75
合计	3,736.61

**6.4.7.6 其他资产**

无余额。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	272,512.76
银行间市场应付交易费用	—
合计	272,512.76

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	6,854.54
指数使用费	16,716.33
证管费返还	18,884.88
审计费	31,240.60
信息披露费	148,765.71
合计	222,462.06

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	597,179,532.42	597,179,532.42
本期申购	81,066,762.50	81,066,762.50
本期赎回（以“-”号填列）	-487,360,220.12	-487,360,220.12
本期末	190,886,074.80	190,886,074.80

注：申购含转换入份额；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	3,845,413.38	167,457,701.43	171,303,114.81
本期利润	220,596,491.64	-107,038,171.79	113,558,319.85
本期基金份额交易产生的变动数	-94,398,444.26	-71,517,700.84	-165,916,145.10
其中：基金申购款	23,905,332.87	17,295,348.36	41,200,681.23
基金赎回款	-118,303,777.13	-88,813,049.20	-207,116,826.33
本期已分配利润	—	—	—

本期末	130,043,460.76	-11,098,171.20	118,945,289.56
-----	----------------	----------------	----------------

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	107,070.02
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	5,214.77
其他	1,313.93
合计	113,598.72

**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2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	222,158,559.53
股票投资收益——赎回差价 收入	—
合计	222,158,559.53

**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 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	836,915,271.70
减：卖出股票成本总额	614,756,712.17
买卖股票差价收入	222,158,559.53

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	61,118.40
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	61,118.40

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	207,320.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	146,000.00
减：应收利息总额	201.60
买卖债券差价收入	61,118.40

**6.4.7.14 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,405,720.24
基金投资产生的股利收益	—
合计	2,405,720.24

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	-107,038,171.79
——股票投资	-107,002,007.59
——债券投资	-36,164.20
——资产支持证券投资	—
——基金投资	0
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	-107,038,171.79

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	462,402.95
转换费收入	28,174.67
合计	490,577.62

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。

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	1,943,613.97
银行间市场交易费用	—
合计	1,943,613.97

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	31,240.60
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	937.14
指数使用费	93,231.74
债券账户维护费	9,000.00
其他手续费	150.00
合计	283,325.19

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》，本基金的指数许可使用费从基金财产中列支，收取标准为每年本基金的资产净值的0.016%，收取下限为每季5万元。

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，每季支付一次。计算方法如下：

日指数许可使用费=前一日基金资产净值 × 0.016% / 当年天数。

#### 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 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

本基金管理人全资控股的子公司国海富兰克林资产管理（上海）有限公司以自有资

金全额出资，成立国海富兰克林投资管理（上海）有限公司，并已在工商行政管理部门办理完成工商注册登记，取得营业执照。

#### 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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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

注：下述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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	203,927,537.31	18.52%	119,455,701.24	8.62%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015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	180,693.08	18.18%	61,721.63	22.65%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	105,703.38	8.47%	25,056.15	3.71%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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的净额列示。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等。

#### 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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,045,233.04	2,166,386.99
其中：支付销售机构的客户维护费	365,539.48	417,720.16

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 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	360,923.47	382,303.49

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。

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

**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**

- 1.基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。
- 2.本报告期和上年度可比期间（2014年1月1日至2014年6月30日）基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**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**

- 1.本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。
- 2.本报告期末和上年度末（2014年12月31日）除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日	2014年1月1日至2014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	15,005,988.22	107,070.02	27,857,091.12	100,682.04

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**

无。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**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（2015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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：新股未上市

富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2015年半年度报告

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
300480	光力科技	2015-06-25	2015-07-02	新股未上市	7.28	7.28	500	3,640	3,640

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	期末成本总额	期末估值总额
600395	盘江股份	2015-06-09	重大事项	15.71	<u>2015-08-19</u>	<u>14.00</u>	14,867	128,716.57	233,560.57
601877	正泰电器	2015-05-29	资产重组	30.62		—	17	329.22	520.54
600153	建发股份	2015-06-29	资产重组	17.51		—	45,274	475,099.65	792,747.74
600277	亿利能源	2015-06-01	重大事项	14.62		—	24,610	195,101.66	359,798.20
600886	国投电力	2015-07-07	重大事项	14.87		—	90,347	845,090.39	1,343,459.89
601111	中国国航	2015-06-30	重大事项	15.36	2015-07-29	14.50	45,400	390,925.36	697,344.00
601216	内蒙君正	2015-06-29	资产重组	24.07	2015-07-02	21.66	16,286	153,184.90	392,004.02
601633	长城汽车	2015-06-19	重大事项	42.76	2015-07-13	44.89	10,788	359,253.25	461,294.88
000539	粤电力A	2015-06-05	重大事项	11.94	2015-07-21	10.75	84	335.10	1,002.96
000778	新兴铸管	2015-06-15	重大事项	12.96		—	64,200	305,666.72	832,032.00
000932	华菱钢铁	2015-05-14	重大事项	4.71	2015-07-16	4.34	34	73.79	160.14
002020	京新药业	2015-04-16	资产重组	27.21	<u>2015-08-10</u>	<u>26.10</u>	74	1,192.74	2,013.54
002075	沙钢股份	2015-06-25	资产重组	33.00		—	1	4.04	33.00
002183	怡亚通	2015-06-01	重大事项	73.15		—	98	944.77	7,168.70
002194	武汉凡谷	2015-06-18	重大事项	26.98	2015-07-24	24.28	33	418.18	890.34
002329	皇氏集团	2015-06-25	重大事项	69.48	<u>2015-08-13</u>	<u>62.53</u>	65	922.23	4,516.20
002444	金洲	2015-	重大事项	15.85	2015-	15.74	44	254.48	697.40

带格式的：字体：小五  
带格式的：缩进：左侧：0.03 厘米  
删除的内容：—

带格式的：字体：小五  
带格式的：缩进：左侧：0.03 厘米  
删除的内容：—

带格式的：字体：小五  
带格式的：缩进：左侧：0.03 厘米  
删除的内容：—

富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2015年半年度报告

3	管道	05-18			07-13				
000630	铜陵有色	2015-03-09	重大事项	8.44		—	77,800	629,516.28	656,632.00
000709	河北钢铁	2015-06-30	重大事项	7.00	<u>2015-08-24</u>	<u>6.30</u>	107,554	353,921.17	752,878.00
000793	华闻传媒	2015-05-26	重大事项	20.75		—	40,558	488,134.02	841,578.50
000839	中信国安	2015-06-29	重大事项	23.57		—	24,134	274,208.86	568,838.38
000878	云南铜业	2015-06-08	重大事项	24.50		—	21,164	310,829.84	518,518.00
000917	电广传媒	2015-05-28	重大事项	42.89		—	23,401	425,520.64	1,003,668.89
000963	华东医药	2015-06-26	重大事项	71.48	<u>2015-08-05</u>	<u>69.20</u>	6,160	343,971.95	440,316.80
002001	新和成	2015-06-30	重大事项	17.09	2015-07-13	18.80	15,392	236,402.67	263,049.28
002106	莱宝高科	2015-05-21	资产重组	16.42		—	52	700.78	853.84
002269	美邦服饰	2015-05-22	重大事项	11.86	2015-07-02	10.67	145	670.72	1,719.70
002292	奥飞动漫	2015-05-18	重大事项	37.85		—	13,108	229,570.42	496,137.80
002310	东方园林	2015-05-27	资产重组	38.30		—	13,094	228,644.32	501,500.20
002353	杰瑞股份	2015-06-03	重大事项	44.35		—	12,666	404,857.86	561,737.10
002375	亚厦股份	2015-06-17	重大事项	29.21	2015-07-20	26.29	15,252	212,244.36	445,510.92
300094	国联水产	2015-06-29	资产重组	31.14		—	29	262.78	903.06
300123	太阳鸟	2015-05-15	资产重组	20.44		—	67	839.95	1,369.48
300190	维尔利	2015-05-25	重大事项	34.34		—	36	465.60	1,236.24
300197	铁汉生态	2015-06-16	重大事项	36.03		—	2	27.13	72.06
300212	易华录	2015-06-30	重大事项	59.94	2015-07-13	65.93	75	2,406.75	4,495.50
000024	招商地产	2015-04-27	资产重组	36.52		—	38,920	960,095.02	1,421,358.40
002268	卫士通	2015-05-08	重大事项	80.14	2015-08-04	<u>76.31</u>	40	754.12	3,205.60

带格式的：字体：小五

带格式的：缩进：左侧： 0.03 厘米

删除的内容：—

带格式的：字体：小五

带格式的：缩进：左侧： 0.03 厘米

带格式的：字体：小五

带格式的：缩进：左侧： 0.03 厘米

删除的内容：—

删除的内容：—

002416	爱施德	2015-05-05	重大事项	20.99	2015-07-29	<a href="#">18.60</a>	7,600	90,473.92	159,524.00
002665	首航节能	2015-07-03	重大事项	29.34	2015-07-24	<a href="#">27.92</a>	68	1,089.20	1,995.12
300113	顺网科技	2015-06-05	重大事项	53.60	<a href="#">2015-08-06</a>	<a href="#">51.93</a>	72	1,868.74	3,859.20
300287	飞利信	2015-06-16	资产重组	38.08		—	102	1,416.95	3,884.16
600900	长江电力	2015-06-13	重大事项	14.35		—	141,388	1,191,639.13	2,028,917.80

注：本基金截至2015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

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 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。本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他证券品种，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险管理委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、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，由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理，由风险控制部负责投资风险管理与绩效评估。

- 删除的内容: —
- 删除的内容: —
- 带格式的: 右侧: 0.16 厘米
- 带格式的: 字体: 小五
- 带格式的: 缩进: 左侧: 0.03 厘米
- 删除的内容: —
- 删除的内容: 600649 ...

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,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。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,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人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交易前均对交易对手进行信用评估并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2015年6月30日,基金未持有信用类债券。(2014年12月31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0.0237%,此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响)

#### 6.4.13.3 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的证券

不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，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。

本基金持有及承担的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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2015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	15,005,988.22	—	—	—	15,005,988.22
结算备付金	144,658.09	—	—	—	144,658.09
存出保证金	194,635.94	—	—	—	194,635.94
交易性金融资产	—	—	—	292,874,651.16	292,874,651.16
应收证券清算款	—	—	—	8,749,112.78	8,749,112.78

富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2015年半年度报告

应收利息	—	—	—	3,736.61	3,736.61
应收申购款	25,006.85	—	—	1,573,453.94	1,598,460.79
资产总计	15,370,289.10	—	—	303,200,954.49	318,571,243.59
负债					
应付赎回款	—	—	—	7,938,832.17	7,938,832.17
应付管理人报酬	—	—	—	260,161.40	260,161.40
应付托管费	—	—	—	45,910.84	45,910.84
应付交易费用	—	—	—	272,512.76	272,512.76
其他负债	—	—	—	222,462.06	222,462.06
负债总计	—	—	—	8,739,879.23	8,739,879.23
利率敏感度缺口	15,370,289.10	—	—	294,461,075.26	309,831,364.36
上年度末 2014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	38,329,228.54	—	—	—	38,329,228.54
结算备付金	994,639.30	—	—	—	994,639.30
存出保证金	34,035.51	—	—	—	34,035.51
交易性金融资产	—	—	182,164.20	725,845,398.29	726,027,562.49
应收证券清算款	—	—	—	13,961,453.63	13,961,453.63
应收利息	—	—	—	8,426.61	8,426.61
应收申购款	1,593.43	—	—	1,862,694.02	1,864,287.45
资产总计	39,359,496.	—	182,164.20	741,677,972	781,219,633

	78			.55	.53
负债					
应付赎回款	—	—	—	11,022,253.17	11,022,253.17
应付管理人报酬	—	—	—	528,400.11	528,400.11
应付托管费	—	—	—	93,247.06	93,247.06
应付交易费用	—	—	—	684,299.45	684,299.45
其他负债	—	—	—	408,786.51	408,786.51
负债总计	—	—	—	12,736,986.30	12,736,986.30
利率敏感度缺口	39,359,496.78	—	182,164.20	728,940,986.25	768,482,647.23

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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

于2015年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2014年12月31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0.0237%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2014年12月31日：同)。

#### 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价格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"自上而下"的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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。

本基金通过投资组合的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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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 2015年6月30日		上年度末 2014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	292,874,651.16	94.53	725,845,398.29	94.45
交易性金融资产-基金投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	292,874,651.16	94.53	725,845,398.29	94.45

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深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 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
	沪深300指数下降5%	减少约1395万元	减少约3666万元
	沪深300指数上升5%	增加约1395万元	增加约3666万元

#### 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2015年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为273,652,959.65元，属于第二层次的余额为19,221,691.51元，无属于第三层次的余额(2014年12月31日：第一层次705,575,273.09元，第二层次20,452,289.40元，无第三层次)。于2015年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债均属于第一层次(2014年12月31日：同)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于2015年3月26日起改为采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注6.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014年12月31日：同)。

(d)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。

(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（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	292,874,651.16	91.93
	其中：股票	292,874,651.16	91.93
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	15,150,646.31	4.76
7	其他资产	10,545,946.12	3.31
8	合计	318,571,243.59	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资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	713,065.00	0.23
B	采矿业	11,288,418.58	3.64
C	制造业	100,074,755.69	32.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,642,323.20	3.76
E	建筑业	12,876,352.03	4.16
F	批发和零售业	7,112,827.05	2.30
G	交通运输、仓储和邮政业	9,532,897.41	3.08
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,539,011.33	4.37
J	金融业	97,829,465.32	31.58
K	房地产业	14,733,838.38	4.76
L	租赁和商务服务业	3,448,985.66	1.11
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	2,425,360.16	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	327,374.48	0.11
R	文化、体育和娱乐业	4,273,166.20	1.38
S	综合	721,876.78	0.23
	合计	290,539,717.27	93.77

## 7.2.2 报告期末积极投资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	903.06	—
B	采矿业	15,325.45	—
C	制造业	1,445,907.81	0.47

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,047.96	—
E	建筑业	13,767.81	—
F	批发和零售业	23,372.02	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,860.36	0.01
J	金融业	137,360.00	0.04
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	271,205.72	0.09
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	4,408.74	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	14,517.00	—
R	文化、体育和娱乐业	351,257.96	0.11
S	综合	—	—
	合计	2,334,933.89	0.75

### 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	134,843	11,049,035.42	3.57
2	600036	招商银行	457,441	8,563,295.52	2.76
3	600016	民生银行	751,388	7,468,796.72	2.41
4	600030	中信证券	227,533	6,122,913.03	1.98
5	600000	浦发银行	351,727	5,965,289.92	1.93
6	601166	兴业银行	316,806	5,464,903.50	1.76
7	600837	海通证券	233,976	5,100,676.80	1.65
8	601766	中国南车	265,745	4,879,078.20	1.57

9	600519	贵州茅台	15,652	4,032,737.80	1.30
10	000651	格力电器	62,046	3,964,739.40	1.28
11	601328	交通银行	435,173	3,585,825.52	1.16
12	000002	万科A	243,350	3,533,442.00	1.14
13	600649	城投控股	242,784	3,408,687.36	1.10
14	601668	中国建筑	386,583	3,212,504.73	1.04
15	601988	中国银行	642,635	3,142,485.15	1.01
16	600887	伊利股份	157,884	2,984,007.60	0.96
17	601818	光大银行	551,800	2,957,648.00	0.95
18	000001	平安银行	189,937	2,761,683.98	0.89
19	601989	中国重工	185,321	2,742,750.80	0.89
20	601398	工商银行	513,600	2,711,808.00	0.88
21	601601	中国太保	82,028	2,475,605.04	0.80
22	601390	中国中铁	176,200	2,412,178.00	0.78
23	601169	北京银行	175,588	2,338,832.16	0.75
24	000166	申万宏源	138,180	2,245,425.00	0.72
25	000783	长江证券	159,600	2,226,420.00	0.72
26	601006	大秦铁路	147,513	2,071,082.52	0.67
27	000333	美的集团	54,294	2,024,080.32	0.65
28	600900	长江电力	140,688	2,018,872.80	0.65
29	000776	广发证券	85,516	1,936,937.40	0.63
30	601939	建设银行	265,900	1,895,867.00	0.61
31	600015	华夏银行	123,368	1,876,427.28	0.61
32	601688	华泰证券	80,944	1,872,234.72	0.60
33	600104	上汽集团	82,825	1,871,845.00	0.60
34	600048	保利地产	161,709	1,846,716.78	0.60
35	600999	招商证券	67,151	1,776,815.46	0.57
36	000858	五粮液	55,894	1,771,839.80	0.57
37	002024	苏宁云商	110,485	1,690,420.50	0.55
38	000725	京东方A	315,000	1,634,850.00	0.53

## 富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2015年半年度报告

39	600795	国电电力	232,915	1,623,417.55	0.52
40	600050	中国联通	211,104	1,547,392.32	0.50
41	000768	中航飞机	34,231	1,491,786.98	0.48
42	600518	康美药业	84,100	1,491,093.00	0.48
43	600637	百视通	34,845	1,466,277.60	0.47
44	600011	华能国际	103,793	1,456,215.79	0.47
45	601377	兴业证券	105,259	1,440,995.71	0.47
46	600383	金地集团	112,713	1,425,819.45	0.46
47	002415	海康威视	31,804	1,424,819.20	0.46
48	000024	招商地产	38,920	1,421,358.40	0.46
49	601901	方正证券	118,978	1,414,648.42	0.46
50	601857	中国石油	120,500	1,365,265.00	0.44
51	601628	中国人寿	43,100	1,349,892.00	0.44
52	600886	国投电力	90,347	1,343,459.89	0.43
53	601336	新华保险	21,742	1,327,566.52	0.43
54	600029	南方航空	90,500	1,315,870.00	0.42
55	600570	恒生电子	11,300	1,266,165.00	0.41
56	000100	TCL 集团	220,128	1,243,723.20	0.40
57	000069	华侨城 A	95,600	1,240,888.00	0.40
58	601186	中国铁建	79,361	1,240,412.43	0.40
59	000538	云南白药	14,129	1,218,908.83	0.39
60	000625	长安汽车	57,255	1,210,943.25	0.39
61	000063	中兴通讯	50,628	1,205,452.68	0.39
62	600690	青岛海尔	39,278	1,191,301.74	0.38
63	600276	恒瑞医药	26,649	1,186,946.46	0.38
64	600109	国金证券	46,382	1,131,720.80	0.37
65	601009	南京银行	49,448	1,127,414.40	0.36
66	600028	中国石化	158,600	1,119,716.00	0.36
67	600585	海螺水泥	51,543	1,105,597.35	0.36
68	000503	海虹控股	22,404	1,097,796.00	0.35

## 富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2015年半年度报告

69	000728	国元证券	28,418	1,079,315.64	0.35
70	600415	小商品城	70,194	1,072,564.32	0.35
71	002304	洋河股份	15,452	1,071,750.72	0.35
72	600019	宝钢股份	121,727	1,063,893.98	0.34
73	300024	机器人	13,700	1,058,462.00	0.34
74	600804	鹏博士	34,500	1,030,170.00	0.33
75	300027	华谊兄弟	26,800	1,022,152.00	0.33
76	600703	三安光电	32,183	1,007,327.90	0.33
77	000917	电广传媒	23,401	1,003,668.89	0.32
78	600089	特变电工	66,801	989,322.81	0.32
79	601899	紫金矿业	191,900	982,528.00	0.32
80	600100	同方股份	46,797	982,269.03	0.32
81	000157	中联重科	120,100	974,011.00	0.31
82	600221	海南航空	152,198	972,545.22	0.31
83	600111	北方稀土	52,943	960,386.02	0.31
84	600271	航天信息	14,514	939,200.94	0.30
85	600839	四川长虹	95,131	936,089.04	0.30
86	601618	中国中冶	125,643	908,398.89	0.29
87	600196	复星医药	31,300	905,822.00	0.29
88	002450	康得新	29,254	895,172.40	0.29
89	000402	金融街	62,943	889,384.59	0.29
90	601018	宁波港	98,939	874,620.76	0.28
91	002241	歌尔声学	24,300	872,370.00	0.28
92	601600	中国铝业	93,085	868,483.05	0.28
93	000338	潍柴动力	27,400	867,484.00	0.28
94	600739	辽宁成大	35,144	859,270.80	0.28
95	600705	中航资本	37,046	857,614.90	0.28
96	601088	中国神华	40,800	850,680.00	0.27
97	600340	华夏幸福	27,864	848,458.80	0.27
98	600588	用友网络	18,346	841,714.48	0.27

## 富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2015年半年度报告

99	000793	华闻传媒	40,558	841,578.50	0.27
100	601669	中国电建	74,129	840,622.86	0.27
101	600535	天士力	16,872	839,550.72	0.27
102	600256	广汇能源	80,710	839,384.00	0.27
103	600352	浙江龙盛	58,758	832,600.86	0.27
104	002594	比亚迪	14,912	823,589.76	0.27
105	002081	金螳螂	29,104	820,441.76	0.26
106	000778	新兴铸管	62,300	807,408.00	0.26
107	600115	东方航空	65,500	806,960.00	0.26
108	600893	中航动力	15,075	801,236.25	0.26
109	600150	中国船舶	15,557	801,185.50	0.26
110	601555	东吴证券	38,995	798,227.65	0.26
111	600153	建发股份	45,274	792,747.74	0.26
112	600009	上海机场	24,897	789,234.90	0.25
113	600031	三一重工	81,029	785,171.01	0.25
114	000568	泸州老窖	23,957	781,237.77	0.25
115	600118	中国卫星	13,710	780,921.60	0.25
116	601866	中海集运	81,740	776,530.00	0.25
117	600406	国电南瑞	37,494	775,750.86	0.25
118	002230	科大讯飞	22,148	773,851.12	0.25
119	000423	东阿阿胶	14,195	773,627.50	0.25
120	002202	金风科技	39,558	770,194.26	0.25
121	601727	上海电气	50,800	758,444.00	0.24
122	000709	河北钢铁	107,554	752,878.00	0.24
123	600177	雅戈尔	40,229	734,581.54	0.24
124	600583	海油工程	44,084	734,439.44	0.24
125	000039	中集集团	22,733	734,275.90	0.24
126	601333	广深铁路	87,400	718,428.00	0.23
127	000559	万向钱潮	32,480	710,012.80	0.23
128	600674	川投能源	56,676	709,016.76	0.23

## 富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2015年半年度报告

129	600066	宇通客车	34,290	704,659.50	0.23
130	000061	农产品	34,400	701,760.00	0.23
131	601111	中国国航	45,400	697,344.00	0.23
132	000623	吉林敖东	20,645	693,672.00	0.22
133	600068	葛洲坝	59,200	692,048.00	0.22
134	601998	中信银行	88,473	682,126.83	0.22
135	002673	西部证券	24,000	680,880.00	0.22
136	600309	万华化学	27,900	674,622.00	0.22
137	300070	碧水源	13,800	673,302.00	0.22
138	000686	东北证券	34,000	661,980.00	0.21
139	002465	海格通信	20,500	659,895.00	0.21
140	000630	铜陵有色	77,800	656,632.00	0.21
141	600085	同仁堂	17,958	644,871.78	0.21
142	600010	包钢股份	124,000	643,560.00	0.21
143	600369	西南证券	32,609	640,766.85	0.21
144	002008	大族激光	22,300	640,456.00	0.21
145	601800	中国交建	36,350	638,306.00	0.21
146	600863	内蒙华电	74,926	612,894.68	0.20
147	600027	华电国际	54,878	610,243.36	0.20
148	601933	永辉超市	52,341	606,632.19	0.20
149	600315	上海家化	13,861	601,567.40	0.19
150	000060	中金岭南	32,240	599,341.60	0.19
151	000629	攀钢钒钛	110,608	592,858.88	0.19
152	600642	申能股份	58,709	587,677.09	0.19
153	601607	上海医药	26,200	583,474.00	0.19
154	600688	上海石化	54,300	582,639.00	0.19
155	601888	中国国旅	8,751	580,191.30	0.19
156	002129	中环股份	29,160	577,076.40	0.19
157	300124	汇川技术	12,000	576,000.00	0.19
158	002065	东华软件	19,854	570,802.50	0.18

## 富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2015年半年度报告

159	002142	宁波银行	26,986	570,753.90	0.18
160	000839	中信国安	24,134	568,838.38	0.18
161	002353	杰瑞股份	12,666	561,737.10	0.18
162	600741	华域汽车	26,235	560,117.25	0.18
163	600023	浙能电力	56,000	555,520.00	0.18
164	000895	双汇发展	25,484	543,573.72	0.18
165	601179	中国西电	52,900	542,225.00	0.18
166	600663	陆家嘴	10,750	534,705.00	0.17
167	002456	欧菲光	15,842	534,509.08	0.17
168	002400	省广股份	20,913	528,262.38	0.17
169	002500	山西证券	29,112	526,636.08	0.17
170	600875	东方电气	25,682	525,710.54	0.17
171	000413	东旭光电	53,688	525,068.64	0.17
172	000800	一汽轿车	20,972	521,783.36	0.17
173	000878	云南铜业	21,164	518,518.00	0.17
174	600660	福耀玻璃	36,200	516,936.00	0.17
175	000009	中国宝安	31,614	515,624.34	0.17
176	000826	桑德环境	13,144	511,170.16	0.16
177	601098	中南传媒	22,300	510,893.00	0.16
178	600018	上港集团	64,511	510,282.01	0.16
179	600060	海信电器	20,700	509,013.00	0.16
180	601168	西部矿业	46,304	505,639.68	0.16
181	600332	白云山	14,651	504,873.46	0.16
182	002310	东方园林	13,094	501,500.20	0.16
183	000425	徐工机械	37,600	498,952.00	0.16
184	601117	中国化学	50,841	497,224.98	0.16
185	002292	奥飞动漫	13,108	496,137.80	0.16
186	002236	大华股份	15,400	491,568.00	0.16
187	600718	东软集团	22,582	490,706.86	0.16
188	002252	上海莱士	7,484	489,752.96	0.16

189	000883	湖北能源	55,200	481,344.00	0.16
190	300017	网宿科技	10,359	480,864.78	0.16
191	600867	通化东宝	21,719	476,297.67	0.15
192	600157	永泰能源	69,194	476,054.72	0.15
193	000792	盐湖股份	16,500	468,270.00	0.15
194	600208	新湖中宝	60,300	465,516.00	0.15
195	000581	威孚高科	14,919	462,339.81	0.15
196	601633	长城汽车	10,788	461,294.88	0.15
197	600489	中金黄金	35,800	460,746.00	0.15
198	600143	金发科技	38,500	458,920.00	0.15
199	600079	人福医药	12,242	453,566.10	0.15
200	300251	光线传媒	18,190	452,931.00	0.15
201	603000	人民网	8,578	447,171.14	0.14
202	002375	亚厦股份	15,252	445,510.92	0.14
203	000598	兴蓉环境	46,300	443,091.00	0.14
204	000963	华东医药	6,160	440,316.80	0.14
205	600362	江西铜业	20,168	433,813.68	0.14
206	600170	上海建工	46,046	431,911.48	0.14
207	600372	中航电子	12,345	431,210.85	0.14
208	601898	中煤能源	37,694	430,465.48	0.14
209	002038	双鹭药业	7,531	426,631.15	0.14
210	600547	山东黄金	17,249	426,050.30	0.14
211	000970	中科三环	20,670	426,008.70	0.14
212	002385	大北农	31,086	420,282.72	0.14
213	600873	梅花生物	40,065	418,278.60	0.14
214	600108	亚盛集团	40,225	416,731.00	0.13
215	002153	石基信息	3,200	415,968.00	0.13
216	601808	中海油服	14,887	415,942.78	0.13
217	601929	吉视传媒	27,380	413,985.60	0.13
218	600600	青岛啤酒	8,876	413,532.84	0.13

219	600827	百联股份	19,518	406,169.58	0.13
220	600655	豫园商城	24,854	398,906.70	0.13
221	002422	科伦药业	9,900	396,396.00	0.13
222	000825	太钢不锈	55,700	396,027.00	0.13
223	002475	立讯精密	11,680	394,900.80	0.13
224	000960	锡业股份	19,592	394,778.80	0.13
225	601216	内蒙君正	16,286	392,004.02	0.13
226	000400	许继电气	15,500	389,980.00	0.13
227	600166	福田汽车	43,044	380,078.52	0.12
228	000027	深圳能源	30,714	379,317.90	0.12
229	000729	燕京啤酒	36,214	376,625.60	0.12
230	601928	凤凰传媒	21,971	375,704.10	0.12
231	600316	洪都航空	10,700	370,006.00	0.12
232	600597	光明乳业	15,959	367,057.00	0.12
233	000831	五矿稀土	14,300	365,794.00	0.12
234	600633	浙报传媒	18,376	360,169.60	0.12
235	600277	亿利能源	24,610	359,798.20	0.12
236	002146	荣盛发展	28,780	359,750.00	0.12
237	600436	片仔癀	5,387	359,151.29	0.12
238	600008	首创股份	24,894	357,228.90	0.12
239	600497	驰宏锌锗	24,298	354,507.82	0.11
240	601258	庞大集团	64,726	353,403.96	0.11
241	002007	华兰生物	7,926	351,042.54	0.11
242	002470	金正大	16,100	349,531.00	0.11
243	002410	广联达	14,867	347,887.80	0.11
244	600498	烽火通信	13,142	347,737.32	0.11
245	600058	五矿发展	10,474	342,185.58	0.11
246	000898	鞍钢股份	46,300	337,990.00	0.11
247	601992	金隅股份	28,002	334,623.90	0.11
248	002570	贝因美	17,112	332,143.92	0.11

249	300015	爱尔眼科	10,148	327,374.48	0.11
250	000999	华润三九	10,700	325,173.00	0.10
251	300133	华策影视	11,850	319,950.00	0.10
252	300058	蓝色光标	20,185	319,124.85	0.10
253	600664	哈药股份	26,100	314,244.00	0.10
254	000876	新希望	16,097	312,442.77	0.10
255	600880	博瑞传播	19,800	307,494.00	0.10
256	000983	西山煤电	32,400	307,152.00	0.10
257	600578	京能电力	34,100	304,513.00	0.10
258	600516	方大炭素	25,157	299,619.87	0.10
259	601118	海南橡胶	30,300	296,334.00	0.10
260	300146	汤臣倍健	7,500	294,600.00	0.10
261	002429	兆驰股份	21,600	278,640.00	0.09
262	600648	外高桥	7,940	278,535.20	0.09
263	601958	金钼股份	23,492	276,735.76	0.09
264	600549	厦门钨业	10,554	266,594.04	0.09
265	002001	新和成	15,392	263,049.28	0.08
266	600348	阳泉煤业	24,887	255,091.75	0.08
267	600809	山西汾酒	8,963	253,115.12	0.08
268	600398	海澜之家	13,900	252,007.00	0.08
269	002603	以岭药业	12,310	248,169.60	0.08
270	002344	海宁皮城	12,587	247,082.81	0.08
271	600267	海正药业	13,140	246,900.60	0.08
272	002294	信立泰	8,582	245,445.20	0.08
273	002051	中工国际	7,901	235,291.78	0.08
274	601699	潞安环能	23,608	228,289.36	0.07
275	002399	海普瑞	6,600	224,334.00	0.07
276	600395	盘江股份	13,967	219,421.57	0.07
277	600038	中直股份	3,390	210,010.50	0.07
278	600783	鲁信创投	5,503	206,252.44	0.07

279	600998	九州通	9,000	201,240.00	0.06
280	000401	冀东水泥	13,500	177,525.00	0.06
281	000937	冀中能源	21,840	175,156.80	0.06
282	000536	华映科技	9,679	169,382.50	0.05
283	600485	信威集团	3,800	166,782.00	0.05
284	000869	张裕A	3,373	164,568.67	0.05
285	002416	爱施德	7,600	159,524.00	0.05
286	601158	重庆水务	14,852	159,510.48	0.05
287	002653	海思科	5,900	159,300.00	0.05
288	601231	环旭电子	7,072	120,294.72	0.04
289	600188	兖州煤业	7,892	108,515.00	0.04
290	603288	海天味业	3,380	107,957.20	0.03
291	601225	陕西煤业	10,300	84,254.00	0.03
292	000156	华数传媒	2,300	82,294.00	0.03
293	603993	洛阳钼业	6,434	79,524.24	0.03
294	603699	纽威股份	1,939	48,455.61	0.02
295	000738	中航动控	800	26,528.00	0.01
296	002269	美邦服饰	145	1,719.70	—
297	002106	莱宝高科	52	853.84	—

## 7.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300003	乐普医疗	13,062	529,925.34	0.17
2	000738	中航动控	10,923	362,206.68	0.12
3	600373	中文传媒	14,215	340,591.40	0.11
4	300058	蓝色光标	15,742	248,881.02	0.08
5	002010	传化股份	11,500	184,920.00	0.06
6	601211	国泰君安	4,000	137,360.00	0.04
7	603288	海天味业	3,608	115,239.52	0.04

## 富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2015年半年度报告

8	600038	中直股份	1,111	68,826.45	0.02
9	300485	赛升药业	500	33,505.00	0.01
10	603616	韩建河山	900	30,906.00	0.01
11	000778	新兴铸管	1,900	24,624.00	0.01
12	002760	凤形股份	500	18,090.00	0.01
13	002400	省广股份	600	15,156.00	0.00
14	300015	爱尔眼科	450	14,517.00	0.00
15	600395	盘江股份	900	14,139.00	0.00
16	002775	文科园林	500	13,410.00	0.00
17	600143	金发科技	1,100	13,112.00	0.00
18	600655	豫园商城	700	11,235.00	0.00
19	600498	烽火通信	400	10,584.00	0.00
20	600900	长江电力	700	10,045.00	0.00
21	600058	五矿发展	300	9,801.00	0.00
22	002153	石基信息	75	9,749.25	0.00
23	600880	博瑞传播	600	9,318.00	0.00
24	600570	恒生电子	77	8,627.85	0.00
25	603699	纽威股份	300	7,497.00	0.00
26	600571	信雅达	68	7,197.80	0.00
27	002183	怡亚通	98	7,168.70	0.00
28	000401	冀东水泥	400	5,260.00	0.00
29	000536	华映科技	300	5,250.00	0.00
30	000869	张裕A	100	4,879.00	0.00
31	300182	捷成股份	94	4,841.00	0.00
32	002329	皇氏集团	65	4,516.20	0.00
33	300212	易华录	75	4,495.50	0.00
34	002358	森源电气	186	3,995.28	0.00
35	300287	飞利信	102	3,884.16	0.00
36	300113	顺网科技	72	3,859.20	0.00
37	300480	光力科技	500	3,640.00	0.00

38	600436	片仔癀	51	3,400.17	0.00
39	002268	卫士通	40	3,205.60	0.00
40	002672	东江环保	150	3,172.50	0.00
41	600305	恒顺醋业	95	2,868.05	0.00
42	002020	京新药业	74	2,013.54	0.00
43	002665	首航节能	68	1,995.12	0.00
44	600318	巢东股份	62	1,519.62	0.00
45	000952	广济药业	99	1,514.70	0.00
46	002233	塔牌集团	80	1,380.80	0.00
47	300123	太阳鸟	67	1,369.48	0.00
48	600180	瑞茂通	45	1,289.70	0.00
49	300190	维尔利	36	1,236.24	0.00
50	000673	当代东方	36	1,186.56	0.00
51	600387	海越股份	41	1,046.32	0.00
52	000539	粤电力A	84	1,002.96	0.00
53	300094	国联水产	29	903.06	0.00
54	002194	武汉凡谷	33	890.34	0.00
55	002443	金洲管道	44	697.40	0.00
56	601699	潞安环能	71	686.57	0.00
57	601877	正泰电器	17	520.54	0.00
58	002475	立讯精密	14	473.34	0.00
59	600157	永泰能源	61	419.68	0.00
60	002062	宏润建设	25	285.75	0.00
61	300133	华策影视	6	162.00	0.00
62	000932	华菱钢铁	34	160.14	0.00
63	300236	上海新阳	3	95.10	0.00
64	000937	冀中能源	10	80.20	0.00
65	300197	铁汉生态	2	72.06	0.00
66	002075	沙钢股份	1	33.00	0.00

## 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	000002	万 科 A	9,662,554.48	1.26
2	601328	交通银行	7,964,734.90	1.04
3	601818	光大银行	7,029,779.00	0.91
4	000001	平安银行	6,577,174.00	0.86
5	600887	伊利股份	6,455,627.87	0.84
6	601398	工商银行	6,440,145.00	0.84
7	601989	中国重工	5,414,451.92	0.70
8	601988	中国银行	5,159,509.00	0.67
9	600048	保利地产	5,147,319.32	0.67
10	601169	北京银行	5,003,531.56	0.65
11	600999	招商证券	4,622,624.25	0.60
12	601390	中国中铁	4,431,140.00	0.58
13	601901	方正证券	3,720,569.00	0.48
14	601377	兴业证券	3,712,832.60	0.48
15	601628	中国人寿	3,518,530.00	0.46
16	000783	长江证券	3,493,581.00	0.45
17	601186	中国铁建	3,247,534.57	0.42
18	601668	中国建筑	3,174,508.00	0.41
19	000858	五 粮 液	3,077,342.00	0.40
20	000725	京东方 A	3,067,571.00	0.40

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 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	601166	兴业银行	32,773,497.71	4.26

2	600030	中信证券	29,206,891.75	3.80
3	601318	中国平安	27,356,264.55	3.56
4	600837	海通证券	22,642,211.49	2.95
5	600015	华夏银行	21,805,794.03	2.84
6	600016	民生银行	17,236,399.20	2.24
7	600036	招商银行	16,547,521.31	2.15
8	600000	浦发银行	14,639,573.00	1.90
9	601939	建设银行	12,368,510.32	1.61
10	601601	中国太保	10,088,434.42	1.31
11	600383	金地集团	9,546,948.83	1.24
12	601299	中国北车	8,364,115.47	1.09
13	600519	贵州茅台	8,336,638.00	1.08
14	000651	格力电器	8,324,807.66	1.08
15	000002	万 科A	8,265,220.00	1.08
16	600739	辽宁成大	8,058,900.00	1.05
17	601088	中国神华	7,091,328.24	0.92
18	000039	中集集团	6,793,501.00	0.88
19	002146	荣盛发展	6,666,602.46	0.87
20	601328	交通银行	6,610,969.30	0.86

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	276,655,568.84
卖出股票的收入（成交）总额	836,915,271.70

注：买入股票成本总额及卖出股票收入总额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 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。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

根据基金合同，本基金不投资贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本期投资的前十名证券中，报告期内发行主体被监管部门立案调查，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、处罚的情况说明如下：

中信证券股份有限公司（以下简称“公司”或“中信证券”）于2015年1月19日公告因存在未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），公司被中国证券监督管理委员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，公司已采取以下整改措施：

- 1、暂停新开立融资融券客户信用账户3个月。
- 2、自2015年1月16日起，公司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，不改变公司长期投资价值。同时由于本公司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票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“公司”或“海通证券”）于2015年1月20日公告2015年1月16日中国证券监督管理委员会公开通报2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况。公司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，公司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，这部分客户数占公司融资融券交易的总客户数不到1%。

目前公司已经采取了以下整改措施：一是暂停新开立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，不改变公司长期投资价值。同时由于本公司看好证券行业整体的发展前景，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票的投资决策遵循公司的投资决策制度。

7.12.2 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。

### 7.12.3 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	194,635.94
2	应收证券清算款	8,749,112.78
3	应收股利	—
4	应收利息	3,736.61
5	应收申购款	1,598,460.79
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	10,545,946.12

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### § 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
15,984	11,942.32	3,605,648.54	1.89%	187,280,426.26	98.11%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	64,795.84	0.033945%

#### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### § 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
本报告期初基金份额总额	597,179,532.42

本报告期基金总申购份额	81,066,762.50
减：本报告期基金总赎回份额	487,360,220.12
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期末基金份额总额	190,886,074.80

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

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四届董事会第十次会议审议通过，毕国强先生不再担任公司总经理，由公司董事长吴显玲女士代为履行总经理职责。相关公告已于2015年4月18日在《中国证券报》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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

#### (一) 基金管理人及高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形：

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

#### (二) 基金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，基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

## 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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	295,009,706.08	26.79%	268,576.26	27.02%	—
海通证券	1	219,039,813.89	19.89%	199,414.55	20.06%	—
国海证券	2	203,927,537.31	18.52%	180,693.08	18.18%	—
中信证券	2	113,918,532.93	10.35%	101,479.87	10.21%	—
安信证券	1	106,489,046.46	9.67%	96,948.54	9.75%	—
国金证券	1	50,298,741.8	4.57%	45,792.38	4.61%	—
国泰君安	1	49,793,037.57	4.52%	44,062.06	4.43%	—
兴业证券	1	28,710,123.18	2.61%	26,137.99	2.63%	—
申万宏源	1	20,480,387.32	1.86%	18,645.67	1.88%	—
国信证券	1	11,594,080.45	1.05%	10,555.49	1.06%	—
方正证券	1	1,722,373.76	0.16%	1,524.1	0.15%	—
招商证券	1	32,411	—	29.5	—	—
中信建投	1	—	—	—	—	—
华泰证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
上海华信	1	—	—	—	—	—

东兴证券	1	—	—	—	—	—
齐鲁证券	1	—	—	—	—	—
民族证券	1	—	—	—	—	—
高华证券	1	—	—	—	—	—

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：

资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；

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；

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；

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；

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

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。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。

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24个：其中国海证券、中信证券、中金公司和华泰证券各2个，兴业证券、申万宏源证券、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、国金证券、上海华信证券、东兴证券、方正证券、民族证券和安信证券各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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
银河证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
国海证券	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
安信证券	—	—	—	—	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	207,320	100%	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
上海华信	—	—	—	—	—	—
东兴证券	—	—	—	—	—	—
齐鲁证券	—	—	—	—	—	—
民族证券	—	—	—	—	—	—
高华证券	—	—	—	—	—	—

## 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参加中国农业银	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-01-12

	行电子渠道基金申购费率优惠活动的公告		
2	富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2014年第四季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-01-21
3	国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券方案及风险控制措施的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-01-27
4	国海富兰克林基金管理有限公司关于开通招商银行借记卡直销网上交易以及费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-03-11
5	国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-03-17
6	国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-03-27
7	富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2014年度年报	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-03-30
8	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金继续参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-03-31
9	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及摘要（2015年1号）	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-04-16
10	国海富兰克林基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-04-18
11	富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2015年第一季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-04-20
12	国海富兰克林基金旗下部分基金	中国证监会指定报刊及公	2015-06-01

	参加农业银行网上银行、手机银行开放式基金申购费率优惠活动的公告	司网站	
13	关于增加海银基金为国海富兰克林基金旗下基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-06-11

## § 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](http://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

二〇一五年八月二十八日