
富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金
2015年年度报告

2015年12月31日

基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016年3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2016年3月23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。

本报告期自2015年1月1日起至12月31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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
8.3 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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
8.6 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	67
8.7 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	68
8.8 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	68
8.9 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	68
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 投资组合报告附注	68
§ 9 基金份额持有人信息	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
9.3 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	70
§ 10 开放式基金份额变动	70
§ 11 重大事件揭示	71
11.1 基金份额持有人大会决议	71
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4 基金投资策略的改变	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
11.8 其他重大事件	75
§ 12 备查文件目录	79
12.1 备查文件目录	79
12.2 存放地点	79
12.3 查阅方式	79

§ 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	172,150,203.46
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标的投资收益，追求基金资产的长期增值。在正常市场情况下，本基金对业绩比较基准的年跟踪误差不超过8%。</p>
投资策略	<p>资产配置策略： 本基金以追求基金资产长期增长的稳定收益为宗旨，在股票市场上进行指数化被动投资的基础上，基金管理人在债券（国债为主）、股票、现金等各类资产之间仅进行适度的主动配置。通过运用深入的基本面分析及先进的数量技术，控制与目标指数的跟踪误差，追求适度超越目标指数的收益。</p> <p>股票投资策略： 本基金以指数化投资为主，以最小化跟踪误差为组合的投资控制目标，本基金所跟踪的目标指数为沪深300指数。</p>

	<p>本产品指数化投资的基础上辅以有限度的增强操作（优化调整）及一级市场股票投资。具体而言，基金将基本依据目标指数的成份股构成权重，并借助数量化投资分析技术构造和调整指数化投资组合。在投资组合建立后，基金定期对比检验组合与比较基准的偏离程度，适时对投资组合进行调整，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投资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	姓名	林葛
	储丽莉	

露负责人	联系电话	021-3855 5555	010-6606 0069
	电子邮箱	service@ftsfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-4518、9510-5680和 021-38789555	95599
传真		021-6888 3050	010-6812 1816
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	北京市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	北京市西城区复兴门内大街 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市卢湾区湖滨路 202 号企 业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	232,887,382.28	2,595,095.65	-51,997,068.00
本期利润	68,854,719.63	241,574,194.46	-63,358,722.84
加权平均基金份额本期利润	0.2700	0.4041	-0.0679
本期加权平均净值利润率	19.02%	45.44%	-7.37%
本期基金份额净值增长率	8.31%	47.42%	-7.72%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配利润	67,810,776.34	3,845,413.38	-82,086,421.75
期末可供分配基金份额利润	0.3939	0.0064	-0.1267
期末基金资产净值	239,960,979.80	768,482,647.23	565,557,073.88
期末基金份额净值	1.394	1.287	0.873
3.1.3 累计期末指标	2015年末	2014年末	2013年末
基金份额累计净值增长率	39.40%	28.70%	-12.70%

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一第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	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④

	率①	率标准 差②	收益率 ③	收益率 标准差 ④		
过去三个月	17.74%	1.63%	15.66%	1.59%	2.08%	0.04%
过去六个月	-14.11%	2.60%	-15.63%	2.54%	1.52%	0.06%
过去一年	8.31%	2.40%	5.72%	2.36%	2.59%	0.04%
过去三年	47.36%	1.70%	45.99%	1.70%	1.37%	0.00%
过去五年	28.24%	1.53%	19.33%	1.53%	8.91%	0.00%
自基金合同生效日起 至今	39.40%	1.51%	28.96%	1.54%	10.44%	-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，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

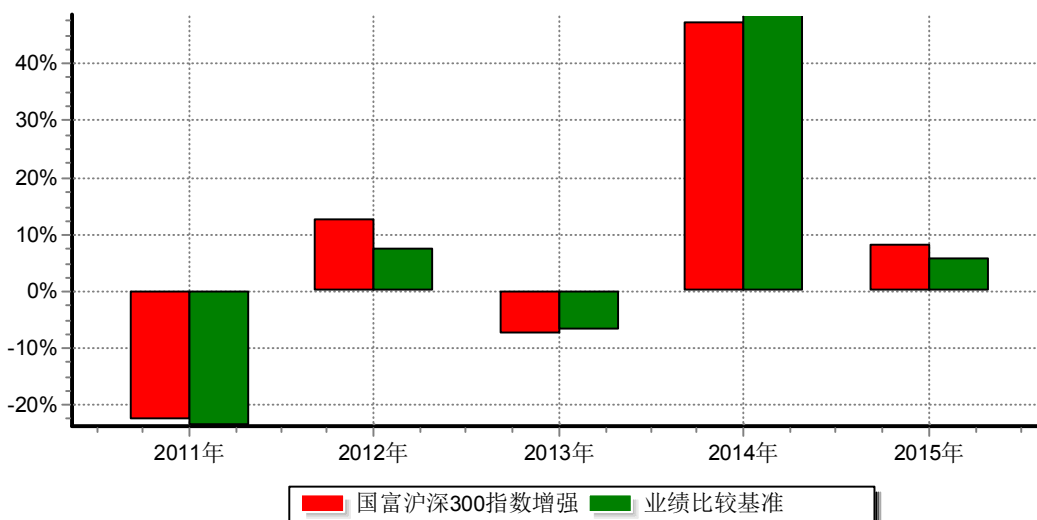
国富沪深300指数增强
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2009年9月3日-2015年12月31日）



注：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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015年	—	—	—	—	
2014年	—	—	—	—	
2013年	—	—	—	—	
合计	—	—	—	—	

§ 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23只基金产品（包含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100指数增强分级基金的基金经理	2013年3月21日	—	13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、业务发展部总经理。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司量化与指数投资总监、金融工程部总经理、职工监事、国富沪深300指数增强基金及国富中证100指数增强分级基金的基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

公司建立了《公平交易管理制度》，确保公司旗下投资组合能够得到公平对待，避免各种投资组合之间的利益输送行为。我们主要从如下几个方面对公平交易进行控制：

1. 在研究信息共享方面，投资研究等部门通过定期的例会沟通机制，就相关议题进行讨论；公司建立了统一的研究平台，研究报告信息通过研究平台进行发布。

2. 建立投资对象备选库，股票及债券的入库需要由研究报告支持作为依据，并经过相关领导审批；建立研究报告的定期更新机制。

3. 在投资决策方面，公司在各类资产管理业务之间建立防火墙，确保业务隔离及人员隔离，同时各投资组合经理投资决策保持独立。

4. 公司对所有投资组合的交易指令实行集中交易，公司在交易系统中设置公平交易功能，按照时间优先、价格优先的原则执行各账户所有指令；公司建立和完善了对债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易分配制度，以确保相关投资组合能够得到公平对待。

5. 公司建立了《同日反向交易管理办法》，通过事前审批来对反向交易进行事前控制。公司每季度对不同时间窗下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。

6. 公司定期对公平交易执行情况进行监察稽核，并在监察稽核定期报告中做专项说明。公司也会在各投资组合的定期报告中，披露公平交易制度执行情况及异常交易行为专项说明。

4.3.2 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。

报告期末，公司共管理了二十三只公募基金及十四只专户产品。统计所有投资组合分投资类别（股票、债券）过去连续4个季度内在不同时间窗口（T=1、T=3和T=5）存在同向交易价差的样本，并对差价率均值、交易价格占优比率、t值、贡献率等指标进行分析。

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。

4.3.3 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。

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，A股市场大涨大跌，经历了急剧转换，沪深300指数全年仅上涨5.58%，但振幅高达68.72%。全年而言，市场展现了显著的成长和小盘风格，以创业板为代表的新兴成长板块大幅领先传统行业的表现。与股市的波澜壮阔相比，实体经济比较沉闷，PMI持续回落，显示工业领域增长压力继续加大，政府的稳增长刺激政策效果不容乐观。投资方面，固定资产投资增速继续放缓，虽然房地产销售转暖，但房地产开发持续下滑的趋势并无改观。消费和进出口的增长依然乏力。除了政策因素、市场投机因素之外，对于经济增长和上市公司利润增长前景的担忧，以及对于流动性宽松状态持续性的担忧，导致了市场的大幅波动。

本基金在投资策略上，在严格控制主动投资风险的同时，主要通过选股策略取得超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日，本基金份额净值为1.394元。本报告期，基金份额净值上涨8.31%，同期业绩比较基准上涨5.72%，基金领先业绩比较基准2.59%，年化跟踪误差为1.73%。

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2016年，无论是经济基本面还是流动性供给都不乐观。传统经济增长模式愈显困难，解决产能过剩问题的过程充满经济层面和社会层面的风险。在经济增长方式转换方面，前一两年广泛宣传的国企改革、放松管制等领域似乎进展甚微，近期虽然政府大力倡导供给侧改革，但具体方式和路径尚不清晰。流动性供给方面，由于政府着眼于供给侧改革，加上美国进入加息周期，货币政策进一步宽松的程度难以超越市场预期。

股票市场的表现依赖于上市公司利润增长、市场流动性和投资者情绪。从目前的情况看，2016年这三个方面都不乐观。此外，政策方面和金融创新方面的气氛与一年前相比也偏冷。综合这些因素，预计2016年市场呈现震荡状态，机会将来自于某些因素的超预期改善。

本基金将在保持对业绩基准的跟踪、控制主动投资风险的基础上，借助量化选股策略，力争取得较好的超额收益。本基金将继续按照基金合同及相关法律法规要求，努力做好基金投资工作，争取未来更好的长期投资收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程，严格开展对基金相关法律文件和对外宣传资料的合规审核，积极加强对各部门、各主要运作环节的风险监控，并通过定期稽核和专项稽核，及时发现需要完善的业务环节，并落实措施。报告期内，本基金管理人特别关注基金投资研究交易、市场销售以及运营的合法合规和风险控制，对保护投资者利益涉及的各业务环节以及信息技术安全开展了专项自查和采取控制措施。同时，本基金管理人开展多层次的员工合规教育和日常提示等措施，强化员工风控意识，努力营造合规经营文化。此外，本基金管理人依照规定，及时向监管部门、董事会报送监察稽核报告。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将继续深入分析和识别市场变化和潜在风险，积极采取措施，加强事前、事中和事后的内部控制，提高监察稽核工作的科学性和有效性。

4.7 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。公司估值委员会由总经理或其任命者负责，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，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。

4.8 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。

4.9 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12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第21767号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金(以下简称“国富沪深300指数增强基金”)的财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是国富沪深300指数增强基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财</p>

	<p>务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述国富沪深300指数增强基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了国富沪深300指数增强基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	单峰、赵钰
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2016-03-23

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	22,689,665.21	38,329,228.54
结算备付金		267,967.30	994,639.30

存出保证金		78,008.63	34,035.51
交易性金融资产	7.4.7.2	217,808,980.98	726,027,562.49
其中：股票投资		217,793,180.98	725,845,398.29
基金投资		—	—
债券投资		15,800.00	182,164.20
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	13,961,453.63
应收利息	7.4.7.5	4,791.11	8,426.61
应收股利		—	—
应收申购款		19,165.10	1,864,287.45
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		240,868,578.33	781,219,633.53
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		0.24	—
应付赎回款		158,536.39	11,022,253.17
应付管理人报酬		173,379.17	528,400.11
应付托管费		30,596.36	93,247.06
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	7.4.7.7	112,977.49	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	7.4.7.8	432,108.88	408,786.51
负债合计		907,598.53	12,736,986.30
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	172,150,203.46	597,179,532.42
未分配利润	7.4.7.1 0	67,810,776.34	171,303,114.81
所有者权益合计		239,960,979.80	768,482,647.23
负债和所有者权益总计		240,868,578.33	781,219,633.53

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.394元，基金份额总额172,150,203.46份。

7.2 利润表

会计主体：富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014 年12月31日
一、收入		75,364,096.75	252,258,541.98
1. 利息收入		176,951.55	233,144.99
其中：存款利息收入	7.4.7.1 1	176,936.33	232,573.51
债券利息收入		15.22	571.48
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）		238,678,732.95	12,965,627.78
其中：股票投资收益	7.4.7.1	234,245,065.16	3,117,834.15

	2		
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.1 3	61,118.40	79,654.69
资产支持证券投资收 益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	7.4.7.1 4	—	—
股利收益	7.4.7.1 5	4,372,549.39	9,768,138.94
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	7.4.7.1 6	-164,032,662.65	238,979,098.81
4. 汇兑收益(损失以“-”号 填列)		—	—
5. 其他收入(损失以“-”号 填列)	7.4.7.1 7	541,074.90	80,670.40
减：二、费用		6,509,377.12	10,684,347.52
1. 管理人报酬		3,087,460.12	4,511,196.59
2. 托管费		544,845.94	796,093.39
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	7.4.7.1 8	2,267,717.05	4,796,580.95
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	7.4.7.1 9	609,354.01	580,476.59
三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)		68,854,719.63	241,574,194.46
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-” 号填列)		68,854,719.63	241,574,194.46

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	597,179,532.4 2	171,303,114.8 1	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)	—	68,854,719.63	68,854,719.63
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)	-425,029,328. 96	-172,347,058. 10	-597,376,387.06
其中：1. 基金申购款	117,439,744.3 8	56,518,380.84	173,958,125.22
2. 基金赎回款	-542,469,073. 34	-228,865,438. 94	-771,334,512.28
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)	172,150,203.4 6	67,810,776.34	239,960,979.80
项 目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	647,643,495.6 3	-82,086,421.7 5	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)	—	241,574,194.4 6	241,574,194.46
三、本期基金份额交易产生的	-50,463,963.2	11,815,342.10	-38,648,621.11

基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1		
其中: 1. 基金申购款	273, 880, 011. 4 8	11, 448, 228. 09	285, 328, 239. 57
2. 基金赎回款	-324, 343, 974. 69	367, 114. 01	-323, 976, 860. 68
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)	597, 179, 532. 4 2	171, 303, 114. 8 1	768, 482, 647. 23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

吴显玲

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第652号《关于核准富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金募集的批复》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2016年3月23日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)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7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年度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12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、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。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金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。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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》、财税[2015]101号《关于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。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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
活期存款	22,689,665.21	38,329,228.54
定期存款	—	—
其中：存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—
合计	22,689,665.21	38,329,228.54

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		191,197,306.20	217,793,180.98	26,595,874.78
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	15,800.00	15,800.00	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	15,800.00	15,800.00	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		191,213,106.20	217,808,980.98	26,595,874.78
项目		上年度末 2014年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		535,253,025.06	725,845,398.29	190,592,373.23
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	146,000.00	182,164.20	36,164.20
	银行间市场	—	—	—

	合计	146,000.00	182,164.20	36,164.20
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
	合计	535,399,025.06	726,027,562.49	190,628,537.43

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	4,632.99	7,774.81
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	120.60	447.60
应收债券利息	2.42	188.80
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	35.10	15.40
合计	4,791.11	8,426.61

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	112,977.49	684,299.45
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	112,977.49	684,299.45

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	224.00	3,417.04
指数使用费	50,000.00	23,484.59
其他	18,884.88	18,884.88
审计费	63,000.00	63,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
合计	432,108.88	408,786.51

7.4.7.9 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12月31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	117,439,744.38	117,439,744.38
本期赎回（以“-”号填列）	-542,469,073.34	-542,469,073.34
本期末	172,150,203.46	172,150,203.46

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,845,413.38	167,457,701.43	171,303,114.81
本期利润	232,887,382.28	-164,032,662.65	68,854,719.63
本期基金份额交易产生的变动数	-107,815,948.74	-64,531,109.36	-172,347,058.10
其中：基金申购款	49,784,694.67	6,733,686.17	56,518,380.84
基金赎回款	-157,600,643.41	-71,264,795.53	-228,865,438.94
本期已分配利润	—	—	—
本期末	128,916,846.92	-61,106,070.58	67,810,776.34

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
活期存款利息收入	167,886.76	212,319.88
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	6,802.86	19,101.26
其他	2,246.71	1,152.37
合计	176,936.33	232,573.51

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	941,858,653.16	1,588,629,758.75

减：卖出股票成本总额	707,613,588.00	1,585,511,924.60
买卖股票差价收入	234,245,065.16	3,117,834.15

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31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	79,654.69
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	79,654.69

7.4.7.13.2 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12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成交总额	207,320.00	503,638.37
减：卖出债券(、债转股及债 券到期兑付)成本总额	146,000.00	423,600.00
减：应收利息总额	201.60	383.68
买卖债券差价收入	61,118.40	79,654.69

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.14.1 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
股票投资产生的股利收益	4,372,549.39	9,768,138.94
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	4,372,549.39	9,768,138.94

7.4.7.16 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12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
1. 交易性金融资产	-164,032,662.65	238,979,098.81
——股票投资	-163,996,498.45	238,942,897.01
——债券投资	-36,164.20	36,201.80
——资产支持证券投资	—	—
——基金投资	—	—
——贵金属投资	—	—
——其他	—	—
2. 衍生工具	—	—
——权证投资	—	—
3. 其他	—	—
合计	-164,032,662.65	238,979,098.81

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
基金赎回费收入	493,400.15	76,318.97
转换费收入	47,674.75	4,351.43
合计	541,074.90	80,670.40

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的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，其中不低于转出赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
交易所市场交易费用	2,267,717.05	4,796,580.95
银行间市场交易费用	—	—
合计	2,267,717.05	4,796,580.95

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
审计费用	63,000.00	63,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费用	1,508.60	1,118.00
指数使用费	226,515.41	197,598.59
债券账户维护费	18,000.00	18,000.00
其他手续费	330.00	760.00
合计	609,354.01	580,476.59

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 X 0.016% / 当年天数。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须做披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
国海证券股份有限公司（“国海证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
邓普顿国际股份有限公司（Templeton International, Inc.）	基金管理人的股东
国海富兰克林资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

国海证券	204,808,677.31	15.69%	347,470,927.48	11.12%
------	----------------	--------	----------------	--------

7.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国海证券	181,496.08	15.36%	803.00	0.71%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国海证券	311,647.41	11.07%	56,959.00	8.32%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,087,460.12	4,511,196.59
其中：支付销售机构的	575,634.56	838,817.01

客户维护费		
-------	--	--

注：支付基金管理人 国海富兰克林基金管理有限公司 的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：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.85% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	544,845.94	796,093.39

注：支付基金托管人中国农业银行的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：日托管费=前一日基金资产净值X 0.15% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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. 本报告期内和上年度可比期间(2014年1月1日至2014年12月31日)基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	22,689,665.21	167,886.76	38,329,228.54	212,319.88

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单价	复牌 日期	复牌 开盘单价	数量 (单位： 股)	期末 成本总额	期末 估值总额
600584	长电科技	2015-11-30	重大资产重组	22.02	—	—	2,700	41,570.00	59,454.00
600654	中安消	2015-12-14	重大事项	28.84	—	—	5,800	186,463.00	167,272.00
600153	建发股份	2015-09-12	重大资产重组	17.31	—	—	45,274	475,099.65	783,692.94
600578	京能电力	2015/11/05	重大资产重组	6.07	2016/02/24	5.49	26,100	167,338.79	158,427.00
600649	城投控股	2015-12-30	重大资产重组	23.16	2016-01-07	20.84	17,584	241,471.52	407,245.44
600699	青岛	2015-	重大资产	9.92	2016-	8.93	73,356	608,777.9	727,691.5

0	海尔	10-30	重组		02-01			7	2
600783	鲁信创投	2015-12-31	重大事项	39.07	2016-01-04	37.60	7,203	152,956.29	281,421.21
600873	梅花生物	2015-12-17	重大事项	9.14	—	—	47,365	307,765.17	432,916.10
601018	宁波港	2015-10-20	重大资产重组	8.16	2016-02-22	7.34	118,739	652,821.16	968,910.24
601377	兴业证券	2015-12-29	重大事项	11.00	2016-01-07	9.40	155,459	1,933,972.70	1,710,049.00
002020	京新药业	2015-12-29	重大事项	33.55	2016-01-20	30.20	74	1,192.74	2,482.70
002075	沙钢股份	2015-06-25	重大资产重组	23.57	2016-01-21	21.21	1	4.04	23.57
002231	奥维通信	2015/12/03	重大资产重组	16.36	2016/03/17	16.00	2,200	39,868.00	35,992.00
002242	九阳股份	2015-12-24	重大事项	22.68	2016-01-11	20.41	400	9,482.00	9,072.00
000002	万科A	2015-12-18	重大资产重组	24.43	—	—	239,250	3,273,078.65	5,844,877.50
000876	新希望	2015/08/17	重大事项	18.99	2016/03/02	17.09	15,697	273,658.70	298,086.03
002065	东华软件	2015-12-21	重大事项	25.10	—	—	8,954	190,415.58	224,745.40
002465	海格通信	2015-12-30	重大事项	16.69	2016-02-04	15.02	17,700	244,163.23	295,413.00
300104	乐视网	2015-12-07	重大资产重组	58.80	—	—	11,400	415,228.90	670,320.00
300197	铁汉生态	2015-12-30	重大事项	17.11	2016-01-07	16.59	3	27.13	51.33
600271	航天信息	2015-10-12	重大资产重组	71.46	—	—	13,314	471,306.54	951,418.44

注：本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末及上年度可比期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

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。

7.4.13.2 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中国农业银行，因而与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。

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12月31日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0.0066%（2014年12月31日：0.0237%）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注7.4.12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。

于2015年12月31日，本基金所承担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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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、结算备付金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2015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	22,689,665.21	—	—	—	22,689,665.21
结算备付金	267,967.30	—	—	—	267,967.30
存出保证金	78,008.63	—	—	—	78,008.63
交易性金融资产	—	—	15,800.00	217,793,180.98	217,808,980.98
应收利息	—	—	—	4,791.11	4,791.11
应收申购款	—	—	—	19,165.10	19,165.10
资产总计	23,035,641.14	—	15,800.00	217,817,137.19	240,868,578.33
负债					
应付证券清算款	—	—	—	0.24	0.24
应付赎回款	—	—	—	158,536.39	158,536.39
应付管理人报酬	—	—	—	173,379.17	173,379.17
应付托管费	—	—	—	30,596.36	30,596.36
应付交易费用	—	—	—	112,977.49	112,977.49

其他负债	—	—	—	432,108.88	432,108.88
负债总计	—	—	—	907,598.53	907,598.53
利率敏感度缺口	23,035,641.14	—	15,800.00	216,909,538.66	239,960,979.80
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	39,359,496.78	—	182,164.20	741,677,972.55	781,219,633.53
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	—	182,164.20	728,940,98	768,482,64

□	.78			6.25	7.23
---	-----	--	--	------	------

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：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0.0066%(2014年12月31日：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)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	217,793,180.9 8	90.76	725,845,398.2 9	94.45
交易性金融资产-基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产-贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	217,793,180.9 8	90.76	725,845,398.2 9	94.45

7.4.13.4.3.2 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：人民币元）	
		本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
	沪深300指数上升5%	增加约1045万元	增加约3666万元
	沪深300指数下降5%	下降约1045万元	下降约3666万元

7.4.14 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12月31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203,763,619.56元，属于第二层次的余额为14,045,361.42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，无属于第三层次的余额)。

(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和债券，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和债券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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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12月31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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	217,793,180.98	90.42

	其中：股票	217,793,180.98	90.42
2	固定收益投资	15,800.00	0.01
	其中：债券	15,800.00	0.01
	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	22,957,632.51	9.53
7	其他各项资产	101,964.84	0.04
8	合计	240,868,578.33	100.00

注：本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

8.2.1.1 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	105,084.00	0.04
B	采矿业	6,678,554.41	2.78
C	制造业	58,025,187.79	24.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,512,594.66	3.13
E	建筑业	8,018,366.66	3.34
F	批发和零售业	4,620,787.67	1.93
G	交通运输、仓储和邮政业	7,204,743.84	3.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,392,971.89	4.33
J	金融业	77,843,119.15	32.44
K	房地产业	11,079,657.69	4.62

L	租赁和商务服务业	1,696,681.38	0.71
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	1,425,765.28	0.59
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	172,047.84	0.07
R	文化、体育和娱乐业	3,152,030.54	1.31
S	综合	831,248.65	0.35
	合计	198,758,841.45	82.83

8.2.1.2 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	255,316.50	0.11
B	采矿业	791,801.50	0.33
C	制造业	10,169,578.78	4.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	582,878.00	0.24
E	建筑业	894,319.90	0.37
F	批发和零售业	2,506,480.29	1.04
G	交通运输、仓储和邮政业	565,538.00	0.24
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,503,468.10	0.63
J	金融业	—	—
K	房地产业	1,048,766.00	0.44
L	租赁和商务服务业	694,092.46	0.29
M	科学研究和技术服务业	11,880.00	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—

Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	10,220.00	—
S	综合	—	—
	合计	19,034,339.53	7.93

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

8.3 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

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600016	民生银行	887,788	8,558,276.32	3.57
2	601318	中国平安	184,286	6,634,296.00	2.76
3	601166	兴业银行	367,006	6,264,792.42	2.61
4	000002	万科A	239,250	5,844,877.50	2.44
5	600030	中信证券	254,333	4,921,343.55	2.05
6	601818	光大银行	1,011,300	4,287,912.00	1.79
7	600015	华夏银行	336,082	4,080,035.48	1.70
8	600036	招商银行	203,941	3,668,898.59	1.53
9	000001	平安银行	293,137	3,514,712.63	1.46
10	601601	中国太保	120,928	3,489,982.08	1.45
11	601398	工商银行	677,100	3,101,118.00	1.29
12	601169	北京银行	287,566	3,028,069.98	1.26
13	601668	中国建筑	412,683	2,616,410.22	1.09
14	000651	格力电器	114,092	2,549,956.20	1.06
15	600000	浦发银行	138,327	2,527,234.29	1.05
16	600887	伊利股份	151,084	2,482,310.12	1.03
17	600837	海通证券	142,176	2,249,224.32	0.94
18	601628	中国人寿	76,200	2,157,222.00	0.90

19	601766	中国中车	160,445	2,061,718.25	0.86
20	000776	广发证券	103,816	2,019,221.20	0.84
21	600048	保利地产	165,509	1,761,015.76	0.73
22	600999	招商证券	79,451	1,724,086.70	0.72
23	601989	中国重工	182,521	1,715,697.40	0.71
24	601377	兴业证券	155,459	1,710,049.00	0.71
25	000333	美的集团	51,594	1,693,315.08	0.71
26	601328	交通银行	242,573	1,562,170.12	0.65
27	601688	华泰证券	72,944	1,438,455.68	0.60
28	300027	华谊兄弟	34,600	1,435,208.00	0.60
29	600104	上汽集团	67,325	1,428,636.50	0.60
30	601186	中国铁建	99,161	1,336,690.28	0.56
31	000625	长安汽车	78,355	1,329,684.35	0.55
32	000039	中集集团	62,133	1,304,793.00	0.54
33	600519	贵州茅台	5,937	1,295,394.03	0.54
34	600050	中国联通	205,604	1,270,632.72	0.53
35	600029	南方航空	145,700	1,248,649.00	0.52
36	600637	东方明珠	32,145	1,217,974.05	0.51
37	000686	东北证券	67,900	1,188,250.00	0.50
38	000063	中兴通讯	63,334	1,179,912.42	0.49
39	601988	中国银行	286,535	1,149,005.35	0.48
40	600900	长江电力	83,288	1,129,385.28	0.47
41	000425	徐工机械	264,300	1,123,275.00	0.47
42	002024	苏宁云商	83,185	1,118,838.25	0.47
43	600011	华能国际	127,193	1,110,394.89	0.46
44	600795	国电电力	275,915	1,084,345.95	0.45
45	300059	东方财富	20,600	1,071,818.00	0.45
46	000858	五粮液	38,494	1,050,116.32	0.44
47	600518	康美药业	60,100	1,018,695.00	0.42
48	002304	洋河股份	14,652	1,004,248.08	0.42

49	600886	国投电力	118,547	989,867.45	0.41
50	601018	宁波港	118,739	968,910.24	0.40
51	600271	航天信息	13,314	951,418.44	0.40
52	601901	方正证券	96,678	928,108.80	0.39
53	600115	东方航空	119,600	910,156.00	0.38
54	000100	TCL 集团	210,128	895,145.28	0.37
55	600221	海南航空	226,098	879,521.22	0.37
56	002415	海康威视	25,104	863,326.56	0.36
57	002673	西部证券	26,200	862,242.00	0.36
58	600739	辽宁成大	38,144	862,054.40	0.36
59	600705	中航资本	54,246	845,152.68	0.35
60	000402	金融街	71,943	829,502.79	0.35
61	601727	上海电气	71,100	820,494.00	0.34
62	000069	华侨城 A	92,900	817,520.00	0.34
63	600100	同方股份	45,197	817,161.76	0.34
64	002252	上海莱士	20,368	810,035.36	0.34
65	000917	电广传媒	30,001	796,826.56	0.33
66	600153	建发股份	45,274	783,692.94	0.33
67	600585	海螺水泥	45,043	770,235.30	0.32
68	600066	宇通客车	34,190	768,933.10	0.32
69	600893	中航动力	17,075	768,887.25	0.32
70	601111	中国国航	89,400	767,052.00	0.32
71	600028	中国石化	151,400	750,944.00	0.31
72	000963	华东医药	9,060	742,557.60	0.31
73	600690	青岛海尔	73,356	727,691.52	0.30
74	601669	中国电建	90,129	723,735.87	0.30
75	601390	中国中铁	65,900	719,628.00	0.30
76	601618	中国中冶	118,843	715,434.86	0.30
77	000503	海虹控股	21,304	713,470.96	0.30
78	600027	华电国际	104,578	711,130.40	0.30

79	600276	恒瑞医药	14,449	709,734.88	0.30
80	600804	鹏博士	29,900	709,228.00	0.30
81	601866	中海集运	100,140	704,985.60	0.29
82	601899	紫金矿业	199,000	700,480.00	0.29
83	300024	机器人	10,050	688,425.00	0.29
84	601939	建设银行	118,600	685,508.00	0.29
85	600703	三安光电	27,983	679,427.24	0.28
86	600547	山东黄金	31,949	670,929.00	0.28
87	300104	乐视网	11,400	670,320.00	0.28
88	000768	中航飞机	26,731	662,126.87	0.28
89	300124	汇川技术	14,000	660,800.00	0.28
90	002450	康得新	16,854	642,137.40	0.27
91	600415	小商品城	69,394	637,730.86	0.27
92	000709	河北钢铁	186,554	621,224.82	0.26
93	000725	京东方A	204,200	606,474.00	0.25
94	601006	大秦铁路	70,013	603,512.06	0.25
95	601857	中国石油	70,300	587,005.00	0.24
96	002594	比亚迪	8,812	567,492.80	0.24
97	600674	川投能源	52,276	562,489.76	0.23
98	601888	中国国旅	9,451	560,538.81	0.23
99	002399	海普瑞	15,700	555,309.00	0.23
100	000166	申万宏源	51,680	553,492.80	0.23
101	000009	中国宝安	30,614	549,827.44	0.23
102	601633	长城汽车	45,664	549,794.56	0.23
103	300017	网宿科技	9,159	549,448.41	0.23
104	600068	葛洲坝	69,700	548,539.00	0.23
105	600660	福耀玻璃	35,100	533,169.00	0.22
106	600111	北方稀土	37,743	529,156.86	0.22
107	601800	中国交建	38,350	514,273.50	0.21
108	600150	中国船舶	14,757	513,986.31	0.21

109	601336	新华保险	9,842	513,850.82	0.21
110	601600	中国铝业	102,885	511,338.45	0.21
111	000895	双汇发展	24,884	507,882.44	0.21
112	600718	东软集团	16,182	502,451.10	0.21
113	002146	荣盛发展	51,180	487,745.40	0.20
114	600583	海油工程	53,584	479,576.80	0.20
115	000783	长江证券	38,500	478,170.00	0.20
116	601991	大唐发电	92,000	472,880.00	0.20
117	300003	乐普医疗	12,162	469,453.20	0.20
118	000538	云南白药	6,429	466,873.98	0.19
119	603000	人民网	20,156	459,758.36	0.19
120	600489	中金黄金	45,800	454,794.00	0.19
121	600741	华域汽车	26,335	444,008.10	0.19
122	601009	南京银行	24,948	441,579.60	0.18
123	002008	大族激光	16,800	434,952.00	0.18
124	600309	万华化学	24,300	433,755.00	0.18
125	600873	梅花生物	47,365	432,916.10	0.18
126	600398	海澜之家	30,700	428,572.00	0.18
127	600010	包钢股份	115,100	415,511.00	0.17
128	002202	金风科技	18,058	411,541.82	0.17
129	001979	招商蛇口	19,562	408,063.32	0.17
130	600649	城投控股	17,584	407,245.44	0.17
131	000793	华闻传媒	26,958	405,178.74	0.17
132	002230	科大讯飞	10,648	394,508.40	0.16
133	600060	海信电器	19,900	391,433.00	0.16
134	600340	华夏幸福	12,464	382,894.08	0.16
135	000629	攀钢钒钛	104,208	382,443.36	0.16
136	600839	四川长虹	65,231	377,687.49	0.16
137	600085	同仁堂	8,458	377,311.38	0.16
138	601117	中国化学	54,641	376,476.49	0.16

139	600688	上海石化	57,900	375,192.00	0.16
140	002142	宁波银行	24,063	373,217.13	0.16
141	300070	碧水源	7,200	372,744.00	0.16
142	600383	金地集团	26,413	364,499.40	0.15
143	600089	特变电工	30,501	358,996.77	0.15
144	600633	浙报传媒	18,876	355,435.08	0.15
145	600570	恒生电子	5,777	352,223.69	0.15
146	601088	中国神华	23,300	348,801.00	0.15
147	600109	国金证券	20,982	338,229.84	0.14
148	600009	上海机场	11,397	336,439.44	0.14
149	000423	东阿阿胶	6,395	334,458.50	0.14
150	600157	永泰能源	69,455	331,300.35	0.14
151	600196	复星医药	14,100	331,209.00	0.14
152	002195	二三四五	8,900	329,300.00	0.14
153	600535	天士力	7,972	326,214.24	0.14
154	600019	宝钢股份	58,227	324,906.66	0.14
155	600369	西南证券	32,718	323,908.20	0.13
156	300058	蓝色光标	21,827	321,511.71	0.13
157	000413	东旭光电	35,088	318,599.04	0.13
158	600352	浙江龙盛	26,858	312,627.12	0.13
159	603993	洛阳钼业	70,002	312,208.92	0.13
160	601788	光大证券	13,600	311,984.00	0.13
161	601258	庞大集团	78,526	307,821.92	0.13
162	000728	国元证券	13,618	307,630.62	0.13
163	000983	西山煤电	50,500	307,040.00	0.13
164	000559	万向钱潮	13,480	305,052.40	0.13
165	002475	立讯精密	9,394	300,138.30	0.13
166	600177	雅戈尔	18,329	298,396.12	0.12
167	600118	中国卫星	7,010	298,205.40	0.12
168	000876	新希望	15,697	298,086.03	0.12

169	002465	海格通信	17,700	295,413.00	0.12
170	600031	三一重工	44,829	294,974.82	0.12
171	600600	青岛啤酒	8,876	294,683.20	0.12
172	000738	中航动控	9,223	291,631.26	0.12
173	002241	歌尔声学	8,400	290,640.00	0.12
174	002292	奥飞动漫	5,608	289,989.68	0.12
175	000630	铜陵有色	80,900	289,622.00	0.12
176	000800	一汽轿车	17,672	289,290.64	0.12
177	600406	国电南瑞	17,194	286,795.92	0.12
178	601998	中信银行	39,473	284,995.06	0.12
179	600958	东方证券	12,200	284,138.00	0.12
180	002736	国信证券	14,300	282,425.00	0.12
181	600783	鲁信创投	7,203	281,421.21	0.12
182	601099	太平洋	28,598	280,832.36	0.12
183	000157	中联重科	51,700	276,595.00	0.12
184	000338	潍柴动力	28,500	275,310.00	0.11
185	600867	通化东宝	9,719	264,065.23	0.11
186	600588	用友网络	8,246	262,305.26	0.11
187	000623	吉林敖东	8,245	255,182.75	0.11
188	002236	大华股份	6,900	254,610.00	0.11
189	002153	石基信息	1,675	252,925.00	0.11
190	600315	上海家化	6,361	251,195.89	0.10
191	601555	东吴证券	15,595	250,611.65	0.10
192	600256	广汇能源	36,910	246,189.70	0.10
193	601106	中国一重	30,800	245,476.00	0.10
194	601933	永辉超市	23,941	241,804.10	0.10
195	600023	浙能电力	32,000	239,680.00	0.10
196	600663	陆家嘴	4,750	238,165.00	0.10
197	000826	启迪桑德	5,944	235,501.28	0.10
198	600373	中文传媒	10,015	235,252.35	0.10

199	601607	上海医药	11,800	234,938.00	0.10
200	000778	新兴铸管	35,500	230,395.00	0.10
201	600005	武钢股份	66,200	229,714.00	0.10
202	601225	陕西煤业	46,600	226,476.00	0.09
203	000729	燕京啤酒	27,314	224,794.22	0.09
204	002065	东华软件	8,954	224,745.40	0.09
205	000568	泸州老窖	8,257	223,929.84	0.09
206	601808	中海油服	14,387	223,286.24	0.09
207	002500	山西证券	14,612	222,686.88	0.09
208	002456	欧菲光	6,842	212,238.84	0.09
209	300146	汤臣倍健	5,500	211,750.00	0.09
210	000060	中金岭南	14,740	206,802.20	0.09
211	300251	光线传媒	6,690	202,640.10	0.08
212	600642	申能股份	26,809	202,407.95	0.08
213	000046	泛海控股	16,100	202,055.00	0.08
214	601333	广深铁路	39,900	199,899.00	0.08
215	600332	白云山	6,551	198,298.77	0.08
216	002385	大北农	16,086	196,410.06	0.08
217	600018	上港集团	30,011	194,471.28	0.08
218	002081	金螳螂	10,404	194,346.72	0.08
219	601992	金隅股份	20,702	193,977.74	0.08
220	000792	盐湖股份	7,500	192,600.00	0.08
221	600875	东方电气	14,082	191,937.66	0.08
222	601098	中南传媒	8,000	191,200.00	0.08
223	601699	潞安环能	29,679	190,539.18	0.08
224	300002	神州泰岳	14,000	183,400.00	0.08
225	603288	海天味业	5,088	179,860.80	0.07
226	000061	农产品	10,000	176,900.00	0.07
227	000581	威孚高科	7,019	173,790.44	0.07
228	300015	爱尔眼科	5,448	172,047.84	0.07

229	601021	春秋航空	2,800	170,800.00	0.07
230	002038	双鹭药业	5,097	170,749.50	0.07
231	002422	科伦药业	8,900	165,540.00	0.07
232	601179	中国西电	24,100	164,121.00	0.07
233	600827	百联股份	9,118	162,938.66	0.07
234	002007	华兰生物	3,626	159,544.00	0.07
235	600578	京能电力	26,100	158,427.00	0.07
236	000883	湖北能源	25,200	154,728.00	0.06
237	600372	中航电子	6,245	153,814.35	0.06
238	600208	新湖中宝	32,200	153,594.00	0.06
239	600863	内蒙华电	34,226	152,990.22	0.06
240	002470	金正大	7,400	150,516.00	0.06
241	000598	兴蓉环境	21,100	150,232.00	0.06
242	601216	君正集团	13,035	149,250.75	0.06
243	600170	上海建工	21,046	149,005.68	0.06
244	600038	中直股份	2,801	147,696.73	0.06
245	600362	江西铜业	9,268	145,878.32	0.06
246	002410	广联达	7,967	144,840.06	0.06
247	300133	华策影视	4,856	144,660.24	0.06
248	002353	杰瑞股份	5,666	143,803.08	0.06
249	000400	许继电气	7,100	137,953.00	0.06
250	000027	深圳能源	14,014	137,477.34	0.06
251	601928	凤凰传媒	8,571	136,536.03	0.06
252	000831	五矿稀土	6,500	134,550.00	0.06
253	000999	华润三九	4,800	131,040.00	0.05
254	601898	中煤能源	21,594	130,643.70	0.05
255	600166	福田汽车	19,644	124,346.52	0.05
256	002129	中环股份	10,160	124,155.20	0.05
257	002375	亚厦股份	7,852	123,826.04	0.05
258	002294	信立泰	3,882	116,925.84	0.05

259	600188	兖州煤业	12,292	116,159.40	0.05
260	600008	首创股份	11,394	116,104.86	0.05
261	600717	天津港	9,900	111,573.00	0.05
262	000825	太钢不锈	26,800	109,880.00	0.05
263	600317	营口港	22,900	108,775.00	0.05
264	601118	海南橡胶	13,900	105,084.00	0.04
265	000898	鞍钢股份	21,700	103,509.00	0.04
266	600485	信威集团	3,600	96,300.00	0.04
267	600549	厦门钨业	4,854	91,303.74	0.04
268	601958	金钼股份	10,792	89,357.76	0.04
269	600648	外高桥	3,340	87,741.80	0.04
270	600998	九州通	4,000	78,400.00	0.03
271	000539	粤电力A	10,484	77,057.40	0.03
272	601969	海南矿业	4,800	67,632.00	0.03
273	601158	重庆水务	6,752	62,996.16	0.03
274	000937	冀中能源	12,450	62,748.00	0.03
275	000156	华数传媒	1,400	45,920.00	0.02
276	601231	环旭电子	2,372	34,299.12	0.01
277	601718	际华集团	800	9,176.00	0.00

注：鉴于部分股票占基金资产净值的比例过于微小，四舍五入后无法通过小数点后两位数据加以列示，故标注为“0.00”。

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

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	002019	亿帆鑫富	20,000	800,000.00	0.33
2	000078	海王生物	22,200	531,912.00	0.22
3	000970	中科三环	36,970	518,689.10	0.22
4	000839	中信国安	24,134	491,126.90	0.20
5	002099	海翔药业	20,400	486,540.00	0.20

6	600713	南京医药	37,800	395,388.00	0.16
7	600316	洪都航空	16,800	392,112.00	0.16
8	002166	莱茵生物	24,800	376,960.00	0.16
9	000878	云南铜业	26,764	370,681.40	0.15
10	002310	东方园林	13,094	346,467.24	0.14
11	000596	古井贡酒	8,200	299,300.00	0.12
12	000600	建投能源	27,500	293,150.00	0.12
13	000966	长源电力	19,200	289,728.00	0.12
14	600199	金种子酒	28,200	283,128.00	0.12
15	600039	四川路桥	52,200	266,220.00	0.11
16	600597	光明乳业	15,859	252,475.28	0.11
17	300085	银之杰	4,400	245,960.00	0.10
18	600399	抚顺特钢	26,000	243,620.00	0.10
19	300071	华谊嘉信	16,600	235,720.00	0.10
20	600108	亚盛集团	31,225	229,191.50	0.10
21	300182	捷成股份	9,435	226,440.00	0.09
22	600277	亿利洁能	24,910	225,933.70	0.09
23	600809	山西汾酒	11,663	224,746.01	0.09
24	600516	方大炭素	17,857	223,391.07	0.09
25	600058	五矿发展	9,474	215,059.80	0.09
26	300300	汉鼎股份	6,400	209,344.00	0.09
27	600676	交运股份	14,800	208,828.00	0.09
28	600057	象屿股份	15,400	200,816.00	0.08
29	002238	天威视讯	9,000	199,800.00	0.08
30	600611	大众交通	12,600	193,410.00	0.08
31	600348	阳泉煤业	29,787	192,424.02	0.08
32	300135	宝利国际	20,700	182,988.00	0.08
33	600435	北方导航	6,000	172,200.00	0.07
34	600652	游久游戏	7,800	170,196.00	0.07
35	000036	华联控股	18,800	168,636.00	0.07

36	600654	中安消	5,800	167,272.00	0.07
37	600658	电子城	11,900	166,243.00	0.07
38	002060	粤水电	17,900	165,038.00	0.07
39	603128	华贸物流	14,200	163,300.00	0.07
40	002221	东华能源	6,900	161,322.00	0.07
41	300032	金龙机电	5,300	161,120.00	0.07
42	600694	大商股份	3,100	160,053.00	0.07
43	601168	西部矿业	21,204	156,697.56	0.07
44	600791	京能置业	16,700	156,646.00	0.07
45	002183	怡亚通	3,398	156,511.88	0.07
46	601233	桐昆股份	11,400	149,910.00	0.06
47	600823	世茂股份	12,100	147,983.00	0.06
48	300136	信维通信	5,000	147,750.00	0.06
49	600657	信达地产	21,200	147,340.00	0.06
50	000545	金浦钛业	16,100	145,705.00	0.06
51	600684	珠江实业	14,100	142,974.00	0.06
52	002419	天虹商场	10,400	140,400.00	0.06
53	000801	四川九洲	4,500	139,185.00	0.06
54	000860	顺鑫农业	6,400	136,320.00	0.06
55	300111	向日葵	20,600	135,548.00	0.06
56	600418	江淮汽车	9,200	134,228.00	0.06
57	002706	良信电器	2,200	129,800.00	0.05
58	601929	吉视传媒	20,860	128,914.80	0.05
59	600778	友好集团	10,500	128,835.00	0.05
60	600885	宏发股份	4,300	128,527.00	0.05
61	002635	安洁科技	4,600	127,880.00	0.05
62	600327	大东方	12,700	127,127.00	0.05
63	300101	振芯科技	4,200	123,942.00	0.05
64	300207	欣旺达	4,400	123,640.00	0.05
65	600497	驰宏锌锗	11,098	122,521.92	0.05

66	000707	双环科技	13,600	122,400.00	0.05
67	000501	鄂武商A	5,700	121,980.00	0.05
68	600500	中化国际	9,400	120,414.00	0.05
69	600559	老白干酒	2,000	120,340.00	0.05
70	600185	格力地产	5,600	118,944.00	0.05
71	600387	海越股份	6,941	117,233.49	0.05
72	002001	新和成	6,692	116,708.48	0.05
73	002051	中工国际	4,601	116,543.33	0.05
74	002534	杭锅股份	6,000	115,920.00	0.05
75	002443	金洲管道	6,444	114,574.32	0.05
76	600755	厦门国贸	12,000	111,840.00	0.05
77	000960	锡业股份	8,192	110,264.32	0.05
78	002601	佰利联	2,800	109,088.00	0.05
79	002190	成飞集成	2,400	105,024.00	0.04
80	000819	岳阳兴长	2,700	101,412.00	0.04
81	002344	海宁皮城	6,587	101,044.58	0.04
82	002326	永太科技	4,800	100,992.00	0.04
83	000096	广聚能源	5,800	99,412.00	0.04
84	600858	银座股份	8,800	97,328.00	0.04
85	002322	理工监测	3,600	90,972.00	0.04
86	002570	贝因美	6,012	89,759.16	0.04
87	600229	城市传媒	5,000	89,250.00	0.04
88	600176	中国巨石	3,400	86,394.00	0.04
89	300381	溢多利	1,500	84,060.00	0.04
90	002643	万润股份	1,800	72,954.00	0.03
91	000159	国际实业	7,500	69,750.00	0.03
92	002382	蓝帆医疗	2,400	67,104.00	0.03
93	601015	陕西黑猫	5,600	65,408.00	0.03
94	002080	中材科技	2,300	61,226.00	0.03
95	600584	长电科技	2,700	59,454.00	0.02

96	002653	海思科	2,700	59,103.00	0.02
97	000571	新大洲A	5,200	43,160.00	0.02
98	600508	上海能源	3,800	39,102.00	0.02
99	601666	平煤股份	8,000	37,280.00	0.02
100	002446	盛路通信	1,000	37,100.00	0.02
101	002231	奥维通信	2,200	35,992.00	0.01
102	002115	三维通信	2,200	34,914.00	0.01
103	300480	光力科技	500	31,680.00	0.01
105	600298	安琪酵母	1,000	30,420.00	0.01
104	002128	露天煤业	3,600	30,420.00	0.01
106	300343	联创股份	300	29,394.00	0.01
107	000998	隆平高科	1,100	26,125.00	0.01
108	002760	凤形股份	500	24,750.00	0.01
109	000708	大冶特钢	2,000	24,420.00	0.01
110	600630	龙头股份	800	23,744.00	0.01
111	002583	海能达	1,800	22,482.00	0.01
112	600132	重庆啤酒	1,400	22,386.00	0.01
113	000932	华菱钢铁	6,834	22,278.84	0.01
114	601005	重庆钢铁	6,600	21,714.00	0.01
115	002640	跨境通	600	19,980.00	0.01
116	300292	吴通控股	400	16,920.00	0.01
117	000158	常山股份	800	16,280.00	0.01
118	000418	小天鹅A	600	14,400.00	0.01
119	002503	搜于特	900	14,256.00	0.01
120	002518	科士达	400	14,120.00	0.01
121	300360	炬华科技	400	14,040.00	0.01
122	002346	柘中股份	700	13,699.00	0.01
123	002269	美邦服饰	2,000	13,420.00	0.01
124	002546	新联电子	400	13,068.00	0.01
125	002516	旷达科技	900	12,960.00	0.01

126	300048	合康变频	600	12,714.00	0.01
127	002733	雄韬股份	400	12,244.00	0.01
128	601616	广电电气	1,400	12,054.00	0.01
129	002276	万马股份	400	12,040.00	0.01
130	300068	南都电源	600	11,904.00	0.00
131	300215	电科院	600	11,880.00	0.00
132	002121	科陆电子	400	11,840.00	0.00
133	600312	平高电气	600	11,700.00	0.00
134	002451	摩恩电气	800	11,640.00	0.00
135	002425	凯撒股份	400	11,596.00	0.00
136	002298	中电鑫龙	600	11,526.00	0.00
137	002225	濮耐股份	1,500	11,475.00	0.00
138	000806	银河生物	400	11,412.00	0.00
139	002364	中恒电气	400	11,284.00	0.00
140	300372	欣泰电气	600	11,250.00	0.00
141	300356	光一科技	200	11,220.00	0.00
142	002531	天顺风能	800	11,000.00	0.00
143	002218	拓日新能	1,000	10,990.00	0.00
144	300274	阳光电源	400	10,968.00	0.00
145	601012	隆基股份	800	10,920.00	0.00
146	603100	川仪股份	600	10,884.00	0.00
147	002302	西部建设	600	10,692.00	0.00
148	002035	华帝股份	600	10,668.00	0.00
149	600468	百利电气	600	10,632.00	0.00
150	002176	江特电机	600	10,560.00	0.00
151	600987	航民股份	800	10,496.00	0.00
152	002255	海陆重工	1,000	10,410.00	0.00
153	600192	长城电工	1,000	10,340.00	0.00
154	002699	美盛文化	200	10,220.00	0.00
155	600517	置信电气	800	10,128.00	0.00

156	600405	动力源	600	10,044.00	0.00
157	300140	启源装备	400	9,960.00	0.00
158	601218	吉鑫科技	1,400	9,786.00	0.00
159	002610	爱康科技	800	9,696.00	0.00
160	002327	富安娜	800	9,624.00	0.00
161	002300	太阳电缆	800	9,600.00	0.00
162	600869	智慧能源	1,000	9,550.00	0.00
163	002028	思源电气	600	9,534.00	0.00
164	002168	深圳惠程	800	9,464.00	0.00
165	600590	泰豪科技	600	9,402.00	0.00
166	300129	泰胜风能	1,000	9,280.00	0.00
167	600290	华仪电气	600	9,246.00	0.00
168	600220	江苏阳光	1,600	9,184.00	0.00
169	002154	报喜鸟	1,200	9,132.00	0.00
170	002242	九阳股份	400	9,072.00	0.00
171	600537	亿晶光电	600	8,988.00	0.00
172	600400	红豆股份	400	8,976.00	0.00
173	300105	龙源技术	800	8,960.00	0.00
174	002441	众业达	400	8,860.00	0.00
175	002617	露笑科技	400	8,840.00	0.00
176	002596	海南瑞泽	200	8,750.00	0.00
177	002184	海得控制	200	8,602.00	0.00
178	603366	日出东方	800	8,480.00	0.00
179	002705	新宝股份	400	8,364.00	0.00
180	002471	中超控股	800	8,048.00	0.00
181	002227	奥特迅	200	7,900.00	0.00
182	002271	东方雨虹	400	7,812.00	0.00
183	002372	伟星新材	400	7,152.00	0.00
184	300286	安科瑞	200	6,880.00	0.00
185	600112	天成控股	400	6,704.00	0.00

186	000921	海信科龙	700	6,671.00	0.00
187	300198	纳川股份	400	6,292.00	0.00
188	002329	皇氏集团	182	5,077.80	0.00
189	002358	森源电气	186	3,431.70	0.00
190	002020	京新药业	74	2,482.70	0.00
191	600305	恒顺醋业	95	2,438.65	0.00
192	300287	飞利信	104	1,882.40	0.00
193	002106	莱宝高科	52	693.68	0.00
194	300197	铁汉生态	3	51.33	0.00
195	002075	沙钢股份	1	23.57	0.00

注：鉴于部分股票占基金资产净值的比例过于微小，四舍五入后无法通过小数点后两位数据加以列示，故标注为“0.00”。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601818	光大银行	10,039,319.00	1.31
2	000002	万科A	9,944,455.48	1.29
3	000001	平安银行	8,634,614.19	1.12
4	601328	交通银行	8,631,945.90	1.12
5	601398	工商银行	7,981,187.00	1.04
6	601988	中国银行	7,725,593.00	1.01
7	600887	伊利股份	6,631,879.87	0.86
8	601989	中国重工	5,946,223.92	0.77
9	601169	北京银行	5,805,103.13	0.76
10	601628	中国人寿	5,753,189.00	0.75
11	600999	招商证券	5,370,816.52	0.70
12	600048	保利地产	5,312,193.32	0.69
13	601390	中国中铁	4,533,740.00	0.59

14	601377	XR兴业证	4,493,628.60	0.58
15	601901	方正证券	4,037,978.00	0.53
16	601668	中国建筑	3,747,429.99	0.49
17	601186	中国铁建	3,663,552.57	0.48
18	000783	长江证券	3,547,869.00	0.46
19	601318	中国平安	3,448,805.00	0.45
20	600030	中信证券	3,358,044.00	0.44

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	33,889,893.71	4.41
2	601318	中国平安	32,062,226.55	4.17
3	600030	中信证券	30,829,332.75	4.01
4	600837	海通证券	24,476,213.49	3.19
5	600015	华夏银行	22,190,487.03	2.89
6	600036	招商银行	21,749,668.31	2.83
7	600000	浦发银行	18,875,056.92	2.46
8	600016	民生银行	18,646,158.20	2.43
9	601939	建设银行	13,769,734.32	1.79
10	600519	贵州茅台	10,681,935.00	1.39
11	601601	中国太保	10,654,216.42	1.39
12	600383	金地集团	10,577,360.83	1.38
13	000651	格力电器	8,662,575.66	1.13
14	000002	万科A	8,602,848.00	1.12
15	601328	交通银行	8,490,854.30	1.10
16	601299	中国北车	8,364,115.47	1.09
17	600739	辽宁成大	8,073,020.00	1.05
18	601988	中国银行	7,791,603.00	1.01

19	601088	中国神华	7,506,144.24	0.98
20	000039	中集集团	6,852,737.00	0.89

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。

8.4.3 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	363,557,869.14
卖出股票的收入（成交）总额	941,858,653.16

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。

8.5 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	15,800.00	0.01
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	15,800.00	0.01

8.6 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

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	123001	蓝标转债	158	15,800.00	0.01

8.7 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。

8.8 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

本基金期末未持有贵金属投资。

8.9 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

本基金报告期末未持有权证。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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：

中信证券于2015年1月19日公告显示，中信证券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），公司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，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。

中信证券于2015年11月29日公告显示，2015年11月26日，中信证券收到中国证监会调查通知书（稽查总队调查通字153121号）。因中信证券涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，中国证监会决定对中信证券进行立案调查。本次调查重点针对中信证券在融资融券业务开展过程中，涉嫌违反《证券公司监督管理条例》第八十四条“未按照规定与客户签订业务合同”的规定。

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。同时由于我们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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	78,008.63
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	4,791.11
5	应收申购款	19,165.10
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	101,964.84

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	5,844,877.50	2.44	重大资产重组

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
14,498	11,874.07	3,605,648.54	2.09%	168,544,554.92	97.91%

9.2 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	0.037639%

9.3 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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年9月3日)基金份额总额	2,423,832,173.19
本报告期期初基金份额总额	597,179,532.42
本报告期基金总申购份额	117,439,744.38
减：本报告期基金总赎回份额	542,469,073.34
本报告期基金拆分变动份额	—

本报告期末基金份额总额	172,150,203.46
-------------	----------------

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(一) 基金管理人重大人事变动

1、经国海富兰克林基金管理有限公司第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。详情请参阅2015年4月18日相关公告。

2、经国海富兰克林基金管理有限公司第四届董事会第二十一次会议审议通过，李彪先生不再担任公司副总经理。详情请参阅2015年12月12日相关公告。

期后事项说明：经国海富兰克林基金管理有限公司股东会2015年第八次会议和第四届董事会第二十二次会议分别审议，同意自2016年1月4日起，Gregory E. McGowan先生担任公司董事长；同意吴显玲女士自2016年1月7日起担任公司总经理，全面主持经营管理工作。详情请参阅2016年1月9日相关公告。

(二) 基金托管人重大人事变动

无。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人应支付给会计师事务所的审计费用是人民币63,000.00元，本基金自成立以来对其进行审计的均为普华永道中天会计师事务所，未曾改聘其他会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

(一) 基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

(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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	339,612,729.76	26.02%	310,115.39	26.24%	
海通证券	1	219,039,813.89	16.78%	199,414.55	16.88%	
国海证券	2	204,808,677.31	15.69%	181,496.08	15.36%	
中信证券	2	154,138,291.89	11.81%	137,950.08	11.67%	
安信证券	2	124,635,151.68	9.55%	113,531.73	9.61%	
国金证券	1	77,738,306.06	5.96%	71,346.96	6.04%	
国泰君安	1	49,793,037.57	3.82%	44,062.06	3.73%	
兴业证券	1	28,710,123.18	2.20%	26,137.99	2.21%	
华泰证券	2	25,850,771.22	1.98%	23,557.72	1.99%	
东兴证券	1	24,788,508.77	1.90%	23,085.58	1.95%	

申万宏源	1	20,480,387 .32	1.57%	18,645.67	1.58%	
国信证券	1	20,180,182 .04	1.55%	18,551.06	1.57%	
方正证券	1	15,174,571 .99	1.16%	13,775.53	1.17%	
招商证券	1	32,411.00	—	29.50	—	
中泰证券	1	10,913.62	—	10.18	—	
中信建投	1	—	—	—	—	
中金公司	2	—	—	—	—	
上海华信	1	—	—	—	—	
民族证券	1	—	—	—	—	
北京高华	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：

- 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) 公司基金交易佣金分配依据券商提供的研究报告和服务质量，评判标准包括但不限于：

- ①全面及时向公司提供高质量的关于宏观、行业和市场的研究报告；
- ②具有数量研究和开发能力；
- ③能有效组织上市公司调研；
- ④能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；
- ⑤上门路演和电话会议的质量；
- ⑥与我公司投资和研究人员的信息交流和沟通能力；
- ⑦其他与投资相关的服务和支持。

3) 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变更情况

报告期内，本基金新增安信证券深圳交易单元1个；新增民族证券深圳交易单元1个；新增方正证券深圳交易单元1个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
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	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—

东兴证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	207,320.00	100.00%	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
上海华信	—	—	—	—	—	—
民族证券	—	—	—	—	—	—
北京高华	—	—	—	—	—	—

11.8 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行电子渠道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	2015-01-12
2	富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2014年第4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1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	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-06-01
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
14	国海富兰克林基金管理有限公司关于公司及高级管理人员投资旗下基金相关事宜的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-07-07
15	富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-07-17
16	关于增加中信期货为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-07-17

	务的公告		
17	富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金2015年第2季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-07-21
18	国海富兰克林基金旗下部分基金参加浦发银行网上银行、手机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	2015-07-31
19	关于国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分股票型基金基金类别变更为混合型基金并修订基金合同的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-08-04
20	关于修订富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金基金合同的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-08-04
21	国海富兰克林基金管理有限公司关于中信证券（浙江）有限责任公司整体迁移并入中信证券股份有限公司涉及相关基金业务影响的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-08-07
22	国海富兰克林基金管理有限公司关于参加数米基金网费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-08-10
23	国海富兰克林基金管理有限公司关于中信证券（浙江）有限责任公司整体迁移并入中信证券股份有限公司涉及相关基金业务影响的补充公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-08-15
24	国海富兰克林基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-08-25
25	富兰克林国海成长动力股票型证券投资基金2015年半年度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-08-25
26	关于中信证券（浙江）有限责任公司整体迁移并入中信证券股份	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-09-01

	有限公司涉及相关基金业务影响的第三次公告		
27	国海富兰克林基金旗下部分基金参加华宝证券开放式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	2015-09-12
28	国海富兰克林基金关于中国农业银行股份有限公司暂停办理业务的配合性公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-09-29
29	富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2015年第3季度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-10-26
30	国海富兰克林基金管理有限公司关于参加上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-11-28
31	关于增加泰诚财富为国海富兰克林基金旗下基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-12-05
32	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	2015-12-12
33	国海富兰克林基金管理有限公司关于参加深圳众禄金融控股股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-12-15
34	国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下基金参加好买基金网费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-12-21
35	关于增加奕丰公司为国海富兰克林基金旗下部分基金代销机构并开通转换业务、定期定额投资业务及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-12-22
36	关于指数熔断机制实施后国海富兰克林基金管理有限公司旗下基	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-12-31

	金相关业务规则说明的公告		
37	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金参加中国工商银行2016倾心回馈基金定投优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-12-31
38	国海富兰克林基金管理有限公司旗下部分基金继续参加苏州银行基金申购及定期定额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	2015-12-31
39	国海富兰克林基金旗下部分基金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	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-12-31
40	国海富兰克林基金基金管理有限公司关于旗下基金参加诺亚正行费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-12-31

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 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 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

二〇一六年三月二十八日