
富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金
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：中国银行股份有限公司

送出日期：2016年03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3月26日（基金合同生效日）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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3 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	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	60
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	60
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12 投资组合报告附注	60
§ 9 基金份额持有人信息	63

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
9.2 期末上市基金前十名持有人	64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
9.4 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	65
§ 10 开放式基金份额变动	66
§ 11 重大事件揭示	66
11.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8 其他重大事件	70
§ 12 备查文件目录	75
12.1 备查文件目录	75
12.2 存放地点	75
12.3 查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金		
基金简称	国富中证100指数增强分级		
基金主代码	164508		
基金运作方式	契约型、开放式		
基金合同生效日	2015年03月26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	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	125,768,789.97		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2015-04-10		
下属分级基金的基金简称	国富100A	国富100B	国富100
下属分级基金的交易代码	150135	150136	164508
报告期末下属分级基金的份 额总额	24,574,125.00	24,574,126.00	76,620,538.97

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金。通过量化风险管理方法，控制基金投资组合与标的指数构成的偏差，同时采取适当的增强策略，在严格控制跟踪误差风险的基础上，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，追求基金资产的长期增值。在正常市场情况下，本基金力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%。
投资策略	本基金基于被动复制的指数化投资方法，在严格控制跟踪误差风险的基础上，适度运用资产配置调整、行业配置调整、指数成份股权重优化等主动增强策略，

	<p>力争获得超越业绩比较基准的投资收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金采取指数增强策略。为控制基金的跟踪误差风险，本基金的资产配置将保持与业绩比较基准基本一致，只在股票、债券（主要是国债）、现金等各大类资产间进行小幅度的主动调整，追求适度超越业绩比较基准的收益目标。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>为严格控制跟踪误差风险，本基金的股票投资以被动复制跟踪标的指数为主，辅以适度的增强策略。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资的主要目的是在保证基金资产流动性的前提下，提高基金资产的投资收益。本基金主要投资于信用等级高、流动性好的政府债券、金融债、企业债等。</p> <p>本基金在进行债券组合管理中，将基于对国内外宏观经济形势、国家财政货币政策动向、市场资金流动性等方面的分析，对利率、信用利差变化的趋势进行判断，综合考察债券的投资价值和流动性等因素，构建和调整债券投资组合。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则参与股指期货交易，以提高投资管理效率，降低跟踪误差风险。</p>
业绩比较基准	中证100指数
风险收益特征	<p>本基金为股票指数增强型基金，属于较高预期收益、较高预期风险的证券投资品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p> <p>在本基金分级运作期内，从本基金所分离出来的两类基金份额来看，由于基金收益分配的安排，国富中证100 A份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征；国</p>

	富中证100 B份额则表现出高风险、收益相对较高的特征。		
下属分级基金的风险收益特征	国富中证100A份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征。	国富中证100B份额则表现出高风险、收益相对较高的特征。	本基金为股票指数增强型基金，属于较高预期收益、较高预期风险的证券投资品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	储丽莉	王永民
	联系电话	021-3855 5555	010-66594896
	电子邮箱	service@ftsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-4518、9510-5680和021-38789555	95566
传真		021-6888 3050	010-6659 4942
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	北京市西城区复兴门内大街1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1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		吴显玲	田国立

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03月26日-2015年12月31日
本期已实现收益	51,147,489.07
本期利润	37,063,431.17
加权平均基金份额本期利润	0.1540
本期基金加权平均净值利润率	15.19%
本期基金份额净值增长率	-11.70%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配利润	-14,661,483.74
期末可供分配基金份额利润	-0.1166
期末基金资产净值	111,107,306.23
期末基金份额净值	0.883
3.1.3 累计期末指标	2015年末
基金份额累计净值增长率	-11.70%

注：

- 1、本基金基金合同生效日为2015年3月26日，本基金本报告期内主要财务指标的计算期间为2015年3月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日。
- 2、上述财务指标采用的计算公式，详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则一第1号《主要财务指标的计算及披露》。
- 3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 4、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。
- 5、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

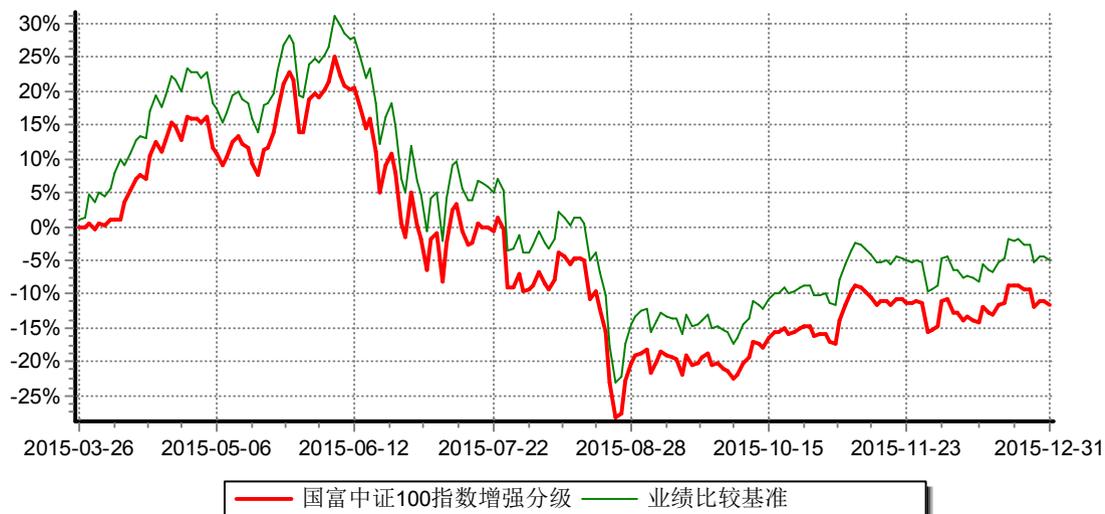
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.06%	1.52%	13.57%	1.51%	-0.51%	0.01%
过去六个月	-15.82%	2.53%	-15.13%	2.46%	-0.69%	0.07%
自基金合同生效日起至今	-11.70%	2.49%	-5.06%	2.44%	-6.64%	0.05%

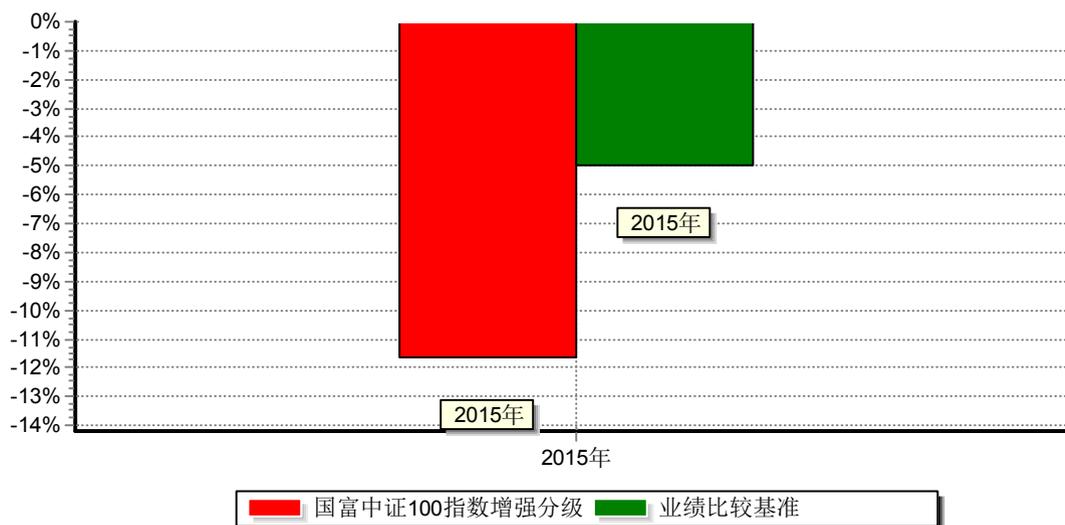
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2015年3月26日-2015年12月31日）



注：本基金的基金合同生效日为2015年3月26日，截止本报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。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 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金成立于2015年3月26日，故2015年的业绩为成立日至年底的业绩而非全年的业绩。

3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期间2015年03月26日（基金合同生效日）至 2015年12月31日
------	--

中证100A与中证100B基金份额配比	1:1
期末中证100A份额参考净值	1.046
期末中证100A份额累计参考净值	1.046
期末中证100B份额参考净值	0.720
期末中证100B份额累计参考净值	0.720
中证100A的预计年收益率	6.00%

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度(国富100A)	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	—	—	—	—	
合计	—	—	—	—	
年度(国富100B)	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	—	—	—	—	
合计	—	—	—	—	
年度(国富100)	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	—	—	—	—	
合计	—	—	—	—	

注：本基金于2015年3月26日成立。

§ 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	2015年03月26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《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金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，中证100指数全年下跌1.52%，但振幅高达62.21%。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。

本基金于2015年3月26日成立，在建仓期间，基金的资产组合与业绩比较基准存在较大差异。建仓完成后，基金保持了均衡的组合配置以控制主动投资风险，同时通过选股策略争取超越业绩比较基准。

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0.883元。自基金成立至本报告期末，基金份额净值下跌11.70%，同期业绩比较基准下跌5.06%，基金表现落后业绩基准6.64%，年化跟踪误差为6.50%。

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。

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项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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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21772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	富兰克林国海中证100指数增强型分级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中证100指数增强型分级证券投资基金(以下简称“国富中证100指数增强分级基金”)的财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表、2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间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中证100指数增强分级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	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>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>
<p>审计意见段</p>	<p>我们认为，上述国富中证100指数增强分级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，公允反映了国富中证100指数增强分级基金2015年12月31日的财务状况以及2015年3月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>单峰、赵钰</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>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</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2016-03-23</p>

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金

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
资产:		
银行存款	7.4.7.1	6,348,526.10
结算备付金		50,441.85
存出保证金		176,548.34
交易性金融资产	7.4.7.2	105,097,781.02
其中: 股票投资		105,097,781.02
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—
应收证券清算款		—
应收利息	7.4.7.5	1,406.88
应收股利		—
应收申购款		1,098.68
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		111,675,802.87
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015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		—
应付赎回款		23,576.00

应付管理人报酬		97,472.18
应付托管费		21,443.89
应付销售服务费		—
应付交易费用	7.4.7.7	38,915.72
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	387,088.85
负债合计		568,496.64
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	125,768,789.97
未分配利润	7.4.7.1 0	-14,661,483.74
所有者权益合计		111,107,306.23
负债和所有者权益总计		111,675,802.87

注：

1. 报告截止日2015年12月31日，基金份额总额125,768,789.97份。其中富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金之基础份额的份额总额为76,620,538.97份，基金份额净值0.883元；富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金之稳健收益类份额总额为24,574,125.00份，基金份额参考净值1.046元；富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金之积极收益类份额总额为24,574,126.00份，基金份额参考净值0.720元。

2、本财务报表的实际编制期间为2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体：富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金

本报告期：2015年03月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2015年03月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日
一、收入		42,137,789.67

1. 利息收入		249,474.52
其中：存款利息收入	7.4.7.1 1	203,481.76
债券利息收入		—
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		45,992.76
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		54,887,024.60
其中：股票投资收益	7.4.7.1 2	50,757,336.69
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.1 3	—
资产支持证券投资收益		—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益		—
股利收益	7.4.7.1 4	4,129,687.91
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.1 5	-14,084,057.90
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 6	1,085,348.45
减：二、费用		5,074,358.50
1. 管理人报酬		1,850,900.14
2. 托管费		407,198.08

3. 销售服务费		—
4. 交易费用	7.4.7.1 7	2,236,314.30
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 8	579,945.98
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		37,063,431.17
减：所得税费用		—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		37,063,431.17

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金

本报告期：2015年03月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年03月26日（基金合同生效日）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)	675,455,568.42	—	675,455,568.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		37,063,431.17	37,063,431.17
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)	-549,686,778.45	-51,724,914.91	-601,411,693.36
其中：1. 基金申购款	244,004,996.39	22,852,369.93	266,857,366.32
2. 基金赎回款	-793,691,774.84	-74,577,284.84	-868,269,059.68

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）	125,768,789.97	-14,661,483.74	111,107,306.23

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

富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金(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[2012]第426号《关于核准富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金募集的批复》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《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币675,295,672.74元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第231号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同》于2015年3月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为675,455,568.42份基金份额,其中认购资金利息折合159,895.68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,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同》和《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金的基金份额包括确认为富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金之基础份额(以下简称“国富中证100份额”),富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“国富中证100 A份额”)及富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“国富中证100 B份额”)。其中,国富中证100 A份额、国富中证100 B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。本基金净资产优先确保国富中证100 A份额的本金及国富中证100 A份额累计约定日应得收

益，即国富中证100 A份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额；本基金在优先确保国富中证100 A份额的本金及累计约定日应得收益后的剩余净资产计为国富中证100 B份额的净资产，即国富中证100 B份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额。基金发售结束后，场外认购的全部份额将确认为国富中证100份额；场内认购的全部份额将按1:1的比例确认为国富中证100 A份额与国富中证100 B份额。本基金基金合同生效后，国富中证100份额与国富中证100 A份额、国富中证100 B份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。基金份额的分拆，指基金份额持有人将其持有的国富中证100份额按照2份场内国富中证100份额对应1份国富中证100 A份额与1份国富中证100 B份额的比例进行转换的行为；基金份额的合并，指基金份额持有人将其持有的国富中证100 A份额与国富中证100 B份额按照国富中证100 A份额与1份国富中证100 B份额对应2份场内国富中证100份额的比例进行转换的行为。

合同生效后，国富中证100份额可办理场外与场内申购和赎回，但不上市交易；国富中证100 A份额、国富中证100 B份额只上市交易，不可单独申购和赎回。本基金的分级运作期为五年(含五年)，分级运作期满后，满足基金合同约定的存续条件，本基金无需召开基金份额持有人大会，国富中证100 A份额和国富中证100 B份额以各自的份额净值为基础，按照国富中证100份额的份额净值自动转换为上市开放式基金(LOF)，基金名称为“富兰克林国海中证100指数增强型证券投资基金(LOF)”。本基金转为上市开放式基金(LOF)后，投资者可通过场内、场外进行基金份额的申购、赎回。

本基金在存续期内的每个会计年度(基金合同生效日所在会计年度除外)第一个工作日对登记在册的国富中证100份额、国富中证100 A份额进行基金的定期份额折算。国富中证100 A份额和国富中证100 B份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行计算，对国富中证100 A份额的应得收益进行定期份额折算，每2份国富中证100份额将按1份国富中证100 A份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，国富中证100 A份额和国富中证100 B份额的份额配比保持1:1的比例。对于国富中证100 A份额的约定年化应得收益，即国富中证100 A份额每个会计年度12月31日份额净值超过1.0000元的部分，将折算为场内国富中证100份额分配给国富中证100 A份额持有人。当国富中证100份额的基金份额净值达到2.0000元或国富中证100 B份额的基金份额参考净值达到0.2500元时，本基金即可确定折算基准日，进行不定期份额折算。在折算基准日，本基金将对登记在册的国富中证100份额、国富中证100 A份额和国富中证100 B份额分别进行折算。份额折算后本基金将确保国富中证100 A份额和国富中证100 B份额的比例为1:1；份额折算后国富中证100份额的基金份额净值、国富中证100 A份额和国富中证100 B份额的参考净值均调整为1.0000元。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]第122号文审核同意,投资者场内认购的全部国富中证100份额按1:1比例自动分拆成的国富中证100 A份额和国富中证100 B份额于2015年4月10日在深圳证券交易所上市。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金作为指数型基金,采用被动复制策略,跟踪标的指数市场表现,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。如果法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产净值的比例为90%-95%,其中投资于股票资产的比例不低于基金资产净值的90%,投资于中证100指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产净值的80%;债券、现金以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为5%-10%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金投资组合的业绩比较基准为中证100指数收益率 \times 95%+银行同业存款利率 \times 5%。

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》、《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金 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3月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等

有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间。

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、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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

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。

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

根据《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同》，在本基金分级运作期内，本基金（包括国富中证100份额、国富中证100 A份额和国富中证100 B份额）不进行收益分配。

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
活期存款	6,348,526.10
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	6,348,526.10

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	119,181,838.92	105,097,781.02	-14,084,057.90
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	119,181,838.92	105,097,781.02	-14,084,057.90

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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
应收活期存款利息	1,304.45
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	22.95
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	0.08
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	79.40
合计	1,406.88

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

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
交易所市场应付交易费用	38,915.72
银行间市场应付交易费用	—
合计	38,915.72

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
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	88.85
指数使用费	50,000.00
审计费	67,000.00
信息披露费	270,000.00
合计	387,088.85

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

国富100	本期2015年03月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	675,455,568.42	675,455,568.42
本期申购	244,004,996.39	244,004,996.39
本期赎回（以“-”号填列）	-793,691,774.84	-793,691,774.84
本期末	125,768,789.97	125,768,789.97

注：

1. 本基金自2015年3月2日至2015年3月20日止期间公开发售，共募集有效净认购资金675,295,672.74元。根据《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入159,895.68元在本基金成立后，折算为159,895.68份基金份额，划入基金份额持有人账户。
2. 根据《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金开放申购、赎回和定期定额投资业务公告》的相关规定，本基金于2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年4月9日止期间暂不向投资人开放基金交易，份额配对转换业务及基础份额的申购、赎回、转入及转出业务自2015年4月10日起开始办理。
3. 截至2015年12月31日止，本基金于深交所上市的国富中证100A份额为24,574,125.00份、国富中证100B份额24,574,126.00份，托管在场内未上市交易的国富中证100份额1,650,110.00份，托管在场外未上市交易的国富中证100份额为74,970,428.97份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。国富中证100份额与国富中证100A份额、国富中证100B份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。

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	—	—	—
本期利润	51,147,489.07	-14,084,057.90	37,063,431.17
本期基金份额交易产生的变动数	-41,028,939.09	-10,695,975.82	-51,724,914.91
其中：基金申购款	12,410,753.11	10,441,616.82	22,852,369.93
基金赎回款	-53,439,692.20	-21,137,592.64	-74,577,284.84
本期已分配利润	—	—	—
本期末	10,118,549.98	-24,780,033.72	-14,661,483.74

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年03月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日
活期存款利息收入	184,964.34
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	14,566.79
其他	3,950.63
合计	203,481.76

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年03月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	50,757,336.69
股票投资收益——赎回差价 收入	—
股票投资收益——申购差价 收入	—
合计	50,757,336.69

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期2015年03月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日
卖出股票成交总额	713,918,570.32
减：卖出股票成本总额	663,161,233.63
买卖股票差价收入	50,757,336.69

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

本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年03月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,129,687.91
基金投资产生的股利收益	—
合计	4,129,687.91

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年03月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-14,084,057.90
——股票投资	-14,084,057.90
——债券投资	—
——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	-14,084,057.90

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015年03月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日
基金赎回费收入	1,085,348.45
合计	1,085,348.45

注：1. 本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的0.5%，赎回费总额的25%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年03月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日
交易所市场交易费用	2,236,314.30
银行间市场交易费用	—
合计	2,236,314.30

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年03月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日
审计费用	67,000.00
信息披露费	270,000.00
股指期货交易费用	—
银行汇划费用	16,064.20
指数使用费	151,481.78
上市年费	75,000.00
债券账户维护费	—
其他手续费	400.00
合计	579,945.98

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的0.02%的费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币50,000.00元。

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

根据《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金招募说明书》和富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管和配对转换业务的公告》的有关规定，本基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司确定2016年1月4日为份额折算基准日对国富中证100份额和国富中证100A份额办理定期份额折算业务。国富中证100份额折算比例为0.028571428，折算前国富中证100场外份额为74,972,119.83份，折算后份额为77,114,180.35份；折算前国富中证100场内份额为1,650,110.00份，折算后份额为3,101,490.00份；国富中证100份额折算后的基金份额净值为0.805元。国富中证100A份额折算比例为0.057142857，折算前份额为24,574,125.00份，折算后份额为24,574,125.00份，折算后基金份额净值为1.001元。

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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03月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国海证券	643,032,738.85	42.98%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内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03月26日（基金合同生效日）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	581,801.07	42.89%		—

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03月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,850,900.14

其中:支付销售机构的客户维护费	431,976.63
-----------------	------------

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1.00%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 1.00% / 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03月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	407,198.08

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.22%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 0.22% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内销售服务费。

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

份额单位:份

项目	本期		
	2015年03月26日(基金合同生效日)至2015年12月31日		
	国富100A	国富100B	国富100
基金合同生效日(2015年3月26日)持有的基金份额	—	—	—
期初持有的基金份额	—	—	—

期间申购/买入总份额	—	—	12,689,086.29
期间因拆分变动份额	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—	—
期末持有的基金份额	—	—	12,689,086.29
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	—	16.56%

注：1. 本基金基金合同生效日为2015年3月26日。

2. 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。

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. 本基金基金合同生效日为2015年3月26日，本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未运用固有资金投资本基金。

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03月26日（基金合同生效日）至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	6,348,526.10	184,964.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额
000002	万科A	15/12/18	重大资产重组	24.43	未复牌	未知	127,400.00	1,772,126.56	3,112,382.00
601377	兴业证券	15/12/29	重大事项	11.00	16/01/07	9.40	77,900.00	961,851.43	856,900.00
601018	宁波港	15/08/04	重大资产重组	8.16	16/02/22	7.34	85,000.00	515,390.60	693,600.00
600690	青岛海尔	15/10/19	重大资产重组	9.92	16/02/01	8.93	57,488.00	746,252.69	570,280.96

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及绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，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，本基金未持有交易性债券投资。

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上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约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、结算备付金及存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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	6,348,526.10	—	—	—	6,348,526.10
结算备付金	50,441.85	—	—	—	50,441.85
存出保证金	176,548.34	—	—	—	176,548.34
交易性金融资产	—	—	—	105,097,781.02	105,097,781.02
应收利息	—	—	—	1,406.88	1,406.88
应收申购款	—	—	—	1,098.68	1,098.68
资产总计	6,575,516.29	—	—	105,100,286.58	111,675,802.87
负债					
应付赎回款	—	—	—	23,576.00	23,576.00
应付管理人报酬	—	—	—	97,472.18	97,472.18
应付托管费	—	—	—	21,443.89	21,443.89
应付交易费用	—	—	—	38,915.72	38,915.72
其他负债	—	—	—	387,088.85	387,088.85
负债总计	—	—	—	568,496.64	568,496.64
利率敏感度缺口	6,575,516.29	—	—	104,531,789.94	111,107,306.23

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

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

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90%-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%-10%。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

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	105,097,781.02	94.59

交易性金融资产-基金投资	—	—
交易性金融资产-债券投资	—	—
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	105,097,781.02	94.59

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证100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
	1. 中证100指数上升5%	增加约504万元
	2. 中证100指数下降5%	下降约504万元

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99,864,618.06元，第二层次的余额为5,233,162.96元，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。

(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	105,097,781.02	94.11
	其中：股票	105,097,781.02	94.11
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	6,398,967.95	5.73
7	其他各项资产	179,053.90	0.16

8	合计	111,675,802.87	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）按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	3,323,097.00	2.99
C	制造业	27,524,977.73	24.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,095,361.96	3.69
E	建筑业	5,041,872.20	4.54
F	批发和零售业	1,044,876.70	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	2,833,016.00	2.55
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,416,221.00	3.07
J	金融业	52,308,610.11	47.08
K	房地产业	4,745,868.32	4.27
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	520,960.00	0.47
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	240,000.00	0.22
S	综合	—	—
	合计	105,094,861.02	94.59

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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	2,920.00	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
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	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	2,920.00	—

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所有股票投资明细

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	601318	中国平安	190,600	6,861,600.00	6.18
2	600016	民生银行	520,300	5,015,692.00	4.51
3	601166	兴业银行	234,800	4,008,036.00	3.61
4	600036	招商银行	181,570	3,266,444.30	2.94
5	000002	万科A	127,400	3,112,382.00	2.80
6	600000	浦发银行	164,200	2,999,934.00	2.70
7	600030	中信证券	147,601	2,856,079.35	2.57
8	601328	交通银行	414,600	2,670,024.00	2.40
9	600837	海通证券	151,600	2,398,312.00	2.16
10	601288	农业银行	673,100	2,174,113.00	1.96
11	601766	中国中车	160,780	2,066,023.00	1.86
12	600519	贵州茅台	8,775	1,914,617.25	1.72
13	601169	北京银行	178,600	1,880,658.00	1.69
14	601398	工商银行	379,700	1,739,026.00	1.57
15	000651	格力电器	77,200	1,725,420.00	1.55
16	600887	伊利股份	104,608	1,718,709.44	1.55
17	601668	中国建筑	263,000	1,667,420.00	1.50
18	601601	中国太保	55,300	1,595,958.00	1.44
19	601989	中国重工	161,000	1,513,400.00	1.36
20	000725	京东方A	416,800	1,237,896.00	1.11
21	600104	上汽集团	58,000	1,230,760.00	1.11
22	600637	东方明珠	32,200	1,220,058.00	1.10
23	000001	平安银行	100,660	1,206,913.40	1.09
24	601688	华泰证券	61,200	1,206,864.00	1.09
25	601818	光大银行	280,400	1,188,896.00	1.07

26	600999	招商证券	54,500	1,182,650.00	1.06
27	600900	长江电力	86,800	1,177,008.00	1.06
28	600015	华夏银行	94,979	1,153,045.06	1.04
29	000333	美的集团	34,200	1,122,444.00	1.01
30	600048	保利地产	103,863	1,105,102.32	0.99
31	300059	东方财富	20,900	1,087,427.00	0.98
32	000776	广发证券	55,500	1,079,475.00	0.97
33	601390	中国中铁	98,135	1,071,634.20	0.96
34	002024	苏宁云商	77,686	1,044,876.70	0.94
35	600276	恒瑞医药	20,610	1,012,363.20	0.91
36	600050	中国联通	148,800	919,584.00	0.83
37	600518	康美药业	54,000	915,300.00	0.82
38	600028	中国石化	184,300	914,128.00	0.82
39	000858	五粮液	33,221	906,268.88	0.82
40	601006	大秦铁路	104,300	899,066.00	0.81
41	000166	申万宏源	83,600	895,356.00	0.81
42	601377	兴业证券	77,900	856,900.00	0.77
43	601628	中国人寿	30,000	849,300.00	0.76
44	601186	中国铁建	60,600	816,888.00	0.74
45	000063	中兴通讯	42,500	791,775.00	0.71
46	601901	方正证券	79,200	760,320.00	0.68
47	002304	洋河股份	10,740	736,119.60	0.66
48	601857	中国石油	87,600	731,460.00	0.66
49	002415	海康威视	21,200	729,068.00	0.66
50	002594	比亚迪	11,100	714,840.00	0.64
51	601211	国泰君安	29,300	700,270.00	0.63
52	601939	建设银行	120,900	698,802.00	0.63
53	600795	国电电力	177,168	696,270.24	0.63
54	601018	宁波港	85,000	693,600.00	0.62
55	000625	长安汽车	40,700	690,679.00	0.62

56	601985	中国核电	71,500	682,110.00	0.61
57	000538	云南白药	9,206	668,539.72	0.60
58	600011	华能国际	75,800	661,734.00	0.60
59	600010	包钢股份	176,100	635,721.00	0.57
60	600893	中航动力	14,000	630,420.00	0.57
61	601727	上海电气	54,600	630,084.00	0.57
62	600585	海螺水泥	36,100	617,310.00	0.56
63	600705	中航资本	38,800	604,504.00	0.54
64	601899	紫金矿业	171,000	601,920.00	0.54
65	601336	新华保险	11,300	589,973.00	0.53
66	601669	中国电建	73,300	588,599.00	0.53
67	600690	青岛海尔	57,488	570,280.96	0.51
68	600485	信威集团	21,100	564,425.00	0.51
69	600111	北方稀土	39,350	551,687.00	0.50
70	601088	中国神华	35,700	534,429.00	0.48
71	601618	中国中冶	87,800	528,556.00	0.48
72	600340	华夏幸福	17,200	528,384.00	0.48
73	000069	华侨城A	59,200	520,960.00	0.47
74	601788	光大证券	22,500	516,150.00	0.46
75	600886	国投电力	61,200	511,020.00	0.46
76	600019	宝钢股份	89,100	497,178.00	0.45
77	601600	中国铝业	98,800	491,036.00	0.44
78	600958	东方证券	20,300	472,787.00	0.43
79	002736	国信证券	23,600	466,100.00	0.42
80	600115	东方航空	61,200	465,732.00	0.42
81	600031	三一重工	68,700	452,046.00	0.41
82	600150	中国船舶	12,408	432,170.64	0.39
83	601998	中信银行	57,400	414,428.00	0.37
84	002252	上海莱士	10,000	397,700.00	0.36
85	601111	中国国航	46,100	395,538.00	0.36

86	600018	上港集团	58,500	379,080.00	0.34
87	601800	中国交建	27,500	368,775.00	0.33
88	600023	浙能电力	49,028	367,219.72	0.33
89	000895	双汇发展	17,300	353,093.00	0.32
90	600398	海澜之家	24,300	339,228.00	0.31
91	601633	长城汽车	21,751	261,882.04	0.24
92	002739	万达院线	2,000	240,000.00	0.22
93	600372	中航电子	9,500	233,985.00	0.21
94	601898	中煤能源	33,000	199,650.00	0.18
95	600959	江苏有线	9,200	189,152.00	0.17
96	601225	陕西煤业	36,100	175,446.00	0.16
97	603288	海天味业	4,880	172,508.00	0.16
98	601808	中海油服	10,700	166,064.00	0.15

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	002785	万里石	500	2,920.00	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”。

8.4 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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	43,955,661.16	39.56
2	600016	民生银行	34,483,324.32	31.04
3	600030	中信证券	33,720,794.11	30.35
4	600036	招商银行	30,746,623.16	27.67

5	601166	兴业银行	26,136,881.20	23.52
6	600837	海通证券	25,551,381.65	23.00
7	600000	浦发银行	22,187,167.12	19.97
8	000002	万科A	14,292,954.17	12.86
9	601288	农业银行	14,029,574.00	12.63
10	000651	格力电器	13,701,678.32	12.33
11	601668	中国建筑	13,254,489.00	11.93
12	601328	交通银行	12,583,187.59	11.33
13	600887	伊利股份	11,894,081.91	10.71
14	600519	贵州茅台	11,807,195.76	10.63
15	601398	工商银行	11,704,732.00	10.53
16	601818	光大银行	11,414,972.00	10.27
17	601601	中国太保	11,219,197.00	10.10
18	601688	华泰证券	10,942,291.00	9.85
19	000776	广发证券	10,664,448.00	9.60
20	000001	平安银行	10,646,813.80	9.58
21	601390	中国中铁	10,300,244.95	9.27
22	000166	申万宏源	10,112,795.71	9.10
23	600999	招商证券	9,933,210.57	8.94
24	600104	上汽集团	9,909,358.01	8.92
25	601989	中国重工	9,448,166.00	8.50
26	601169	北京银行	9,219,814.00	8.30
27	000333	美的集团	9,004,633.00	8.10
28	601006	大秦铁路	8,044,427.00	7.24
29	600048	保利地产	8,011,827.25	7.21
30	601628	中国人寿	7,714,531.57	6.94
31	600010	包钢股份	7,686,999.68	6.92
32	000725	京东方A	7,652,457.00	6.89
33	601901	方正证券	7,626,259.00	6.86
34	601857	中国石油	7,538,203.00	6.78

35	601939	建设银行	7,489,244.72	6.74
36	601766	中国中车	7,081,788.00	6.37
37	002024	苏宁云商	7,070,310.00	6.36
38	600015	华夏银行	6,965,166.95	6.27
39	601186	中国铁建	6,725,599.00	6.05
40	600900	长江电力	6,626,343.00	5.96
41	600518	康美药业	6,587,451.00	5.93
42	600028	中国石化	6,504,904.00	5.85
43	600050	中国联通	6,344,741.00	5.71
44	601299	中国北车	5,950,279.00	5.36
45	600795	国电电力	5,910,775.37	5.32
46	600637	东方明珠	5,910,763.13	5.32
47	000858	五粮液	5,824,742.99	5.24
48	600111	北方稀土	5,537,357.35	4.98
49	600031	三一重工	5,504,951.00	4.95
50	600019	宝钢股份	5,483,188.00	4.94
51	600585	海螺水泥	5,482,667.00	4.93
52	000063	中兴通讯	5,405,728.00	4.87
53	600383	金地集团	5,321,438.19	4.79
54	000157	中联重科	5,235,399.05	4.71
55	601899	紫金矿业	5,103,278.00	4.59
56	600011	华能国际	5,069,445.00	4.56
57	600690	青岛海尔	5,024,729.92	4.52
58	601088	中国神华	4,978,780.32	4.48
59	601336	新华保险	4,958,292.00	4.46
60	600276	恒瑞医药	4,741,963.00	4.27
61	002415	海康威视	4,701,327.00	4.23
62	000538	云南白药	4,450,773.15	4.01
63	600256	广汇能源	4,093,084.00	3.68
64	600406	国电南瑞	3,945,593.00	3.55

65	000338	潍柴动力	3,915,499.00	3.52
66	600309	万华化学	3,871,419.23	3.48
67	601600	中国铝业	3,868,486.00	3.48
68	600703	三安光电	3,794,594.54	3.42
69	600535	天士力	3,732,986.26	3.36
70	600150	中国船舶	3,725,972.16	3.35
71	000069	华侨城A	3,721,302.00	3.35
72	002304	洋河股份	3,644,543.36	3.28
73	601800	中国交建	3,633,743.93	3.27
74	601669	中国电建	3,603,989.40	3.24
75	002594	比亚迪	3,509,913.00	3.16
76	600583	海油工程	3,388,993.00	3.05
77	002241	歌尔声学	3,365,376.54	3.03
78	000625	长安汽车	3,358,913.53	3.02
79	601998	中信银行	3,344,610.00	3.01
80	601727	上海电气	3,315,310.00	2.98
81	601618	中国中冶	3,181,319.00	2.86
82	002353	杰瑞股份	3,058,627.00	2.75
83	000895	双汇发展	2,922,050.00	2.63
84	601633	长城汽车	2,860,851.97	2.57
85	601018	宁波港	2,672,418.90	2.41
86	002236	大华股份	2,547,270.00	2.29
87	600196	复星医药	2,537,322.79	2.28
88	600362	江西铜业	2,515,129.00	2.26
89	600018	上港集团	2,386,088.00	2.15
90	601117	中国化学	2,248,852.00	2.02
91	601111	中国国航	2,241,564.00	2.02

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	38,324,355.26	34.49
2	600036	招商银行	31,161,012.72	28.05
3	600016	民生银行	31,058,288.02	27.95
4	600030	中信证券	28,508,226.78	25.66
5	600837	海通证券	23,933,253.87	21.54
6	601166	兴业银行	22,324,844.07	20.09
7	600000	浦发银行	21,266,956.89	19.14
8	601668	中国建筑	13,487,276.62	12.14
9	000651	格力电器	13,211,384.80	11.89
10	000002	万科A	13,166,333.00	11.85
11	601390	中国中铁	13,015,795.00	11.71
12	600519	贵州茅台	12,102,299.46	10.89
13	601288	农业银行	12,092,817.00	10.88
14	600887	伊利股份	11,606,761.03	10.45
15	601818	光大银行	10,912,687.45	9.82
16	000001	平安银行	10,831,567.89	9.75
17	601328	交通银行	10,459,954.00	9.41
18	601398	工商银行	10,343,881.00	9.31
19	601989	中国重工	10,110,776.00	9.10
20	601601	中国太保	9,259,140.40	8.33
21	000776	广发证券	8,903,459.00	8.01
22	601688	华泰证券	8,826,428.00	7.94
23	000166	申万宏源	8,793,353.00	7.91
24	600999	招商证券	8,682,393.00	7.81
25	601169	北京银行	8,421,978.00	7.58
26	600104	上汽集团	8,382,091.20	7.54
27	000333	美的集团	7,910,250.92	7.12

28	601006	大秦铁路	7,804,195.39	7.02
29	600048	保利地产	7,330,996.73	6.60
30	600050	中国联通	7,286,565.68	6.56
31	601939	建设银行	7,135,396.75	6.42
32	002024	苏宁云商	6,947,315.00	6.25
33	601857	中国石油	6,914,193.14	6.22
34	600015	华夏银行	6,899,681.76	6.21
35	601186	中国铁建	6,720,882.18	6.05
36	600010	包钢股份	6,644,068.32	5.98
37	601901	方正证券	6,629,030.00	5.97
38	601628	中国人寿	6,606,463.60	5.95
39	000725	京东方A	6,489,820.00	5.84
40	600518	康美药业	6,486,987.98	5.84
41	600900	长江电力	6,336,343.83	5.70
42	600383	金地集团	6,283,253.60	5.66
43	600795	国电电力	6,131,852.67	5.52
44	601766	中国中车	6,028,653.52	5.43
45	000157	中联重科	5,780,719.81	5.20
46	000063	中兴通讯	5,674,425.00	5.11
47	600028	中国石化	5,650,973.00	5.09
48	000858	五粮液	5,476,459.00	4.93
49	600111	北方稀土	5,118,101.00	4.61
50	600019	宝钢股份	5,101,831.00	4.59
51	600011	华能国际	5,080,870.11	4.57
52	601899	紫金矿业	4,937,173.28	4.44
53	600585	海螺水泥	4,758,618.95	4.28
54	600276	恒瑞医药	4,738,065.12	4.26
55	002415	海康威视	4,700,511.04	4.23
56	600031	三一重工	4,693,388.34	4.22
57	601336	新华保险	4,498,740.85	4.05

58	600690	青岛海尔	4,490,091.00	4.04
59	601618	中国中冶	4,368,352.00	3.93
60	601088	中国神华	4,329,092.70	3.90
61	600703	三安光电	4,224,205.54	3.80
62	000338	潍柴动力	4,109,783.00	3.70
63	000538	云南白药	4,051,460.09	3.65
64	601669	中国电建	4,016,607.00	3.62
65	600256	广汇能源	4,003,978.64	3.60
66	600309	万华化学	3,871,972.99	3.48
67	600637	东方明珠	3,853,516.08	3.47
68	600406	国电南瑞	3,774,362.12	3.40
69	601600	中国铝业	3,705,785.00	3.34
70	600150	中国船舶	3,639,833.04	3.28
71	600535	天士力	3,607,571.44	3.25
72	002241	歌尔声学	3,474,164.00	3.13
73	601727	上海电气	3,368,746.00	3.03
74	002304	洋河股份	3,312,931.26	2.98
75	000069	华侨城A	3,297,934.00	2.97
76	600583	海油工程	3,270,961.00	2.94
77	601018	宁波港	3,238,083.00	2.91
78	002594	比亚迪	3,219,284.58	2.90
79	601800	中国交建	3,164,162.00	2.85
80	601998	中信银行	3,076,475.00	2.77
81	002236	大华股份	2,757,299.00	2.48
82	002353	杰瑞股份	2,715,959.68	2.44
83	601117	中国化学	2,706,328.62	2.44
84	600362	江西铜业	2,594,655.00	2.34
85	600196	复星医药	2,588,739.22	2.33
86	000895	双汇发展	2,497,593.00	2.25
87	600018	上港集团	2,324,743.00	2.09

88	601633	长城汽车	2,305,231.55	2.07
----	--------	------	--------------	------

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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	782,343,072.55
卖出股票收入（成交）总额	713,918,570.32

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（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

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本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

根据基金合同，本基金不投资贵金属。

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

本基金本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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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。

海通证券于2015年1月20日公告显示，2015年1月16日中国证监会公开通报2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况。海通证券因存在违规为到期融资融券合约展期问题，受到暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。经查，海通证券存在为少数融资融券六个月到期并提出逾期负债暂缓平仓申请的客户，在维持担保比例处于150%以上的前提下暂缓平仓的行为，这部分客户数占公司融资融券交易的总客户数不到1%。目前海通证券已经采取了以下整改措施：一是暂停新开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。

海通证券于2015年9月11日公告显示，海通证券收到中国证监会行政处罚事先告知书。海通证券涉嫌违法违规的事实如下：

海通证券上海建国西路营业部和杭州解放路营业部对杭州恒生网络技术服务有限责任公司HOMS系统开放专线接入，其中第一条专线于2014年3月由零售与网络金融部、信息技术管理部、合规与风险管理总部平行审核后接入上线。第二条专线于2015年2月

由零售与网络金融部、合规与风险管理总部、信息技术管理部平行审核后接入上线。对于上述外部接入的第三方交易终端软件，海通证券未进行软件认证许可，未对外部系统接入实施有效管理，对相关客户身份情况缺乏了解。

根据当事人违法行为的事实、性质、情节和社会危害程度，依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定，证监会拟决定：

- 1、对海通证券责令改正，给予警告，没收违法所得28,653,000元，并处以85,959,000元罚款；
- 2、对丁学清给予警告，并处以10万元罚款；
- 3、对邹二海给予警告，并处以10万元罚款；
- 4、对高宏杰给予警告，并处以10万元罚款；
- 5、对汪峥给予警告，并处以5万元罚款；
- 6、对方贤明给予警告，并处以5万元罚款；
- 7、对沈云明给予警告，并处以5万元罚款；
- 8、对宋世浩给予警告，并处以5万元罚款。

海通证券于2015年11月29日公告显示，2015年11月26日海通证券收到中国证监会调查通知书（稽查总队调查通字153122号）。因海通证券涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对海通证券进行立案调查。本次调查重点针对海通证券在融资融券业务中涉嫌违反《证券公司监督管理条例》第八十四条“未按规定与客户签订业务合同”的规定。

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，因此买入海通证券。本基金管理人对该股的投资决策遵循公司的投资决策制度。

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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	176,548.34
2	应收证券清算款	—

3	应收股利	—
4	应收利息	1,406.88
5	应收申购款	1,098.68
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	179,053.90

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间的可转债。

8.12.5 期末前十名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	3,112,382.00	2.80	重大资产重组停牌

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

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。

§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

份额级别	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

国富100A	127	193,497.05	16,702,997.00	67.97%	7,871,128.00	32.03%
国富100B	644	38,158.58	30,000.00	0.12%	24,544,126.00	99.88%
国富100	1,758	43,583.92	12,689,145.29	16.56%	63,931,393.68	83.44%
合计	2,529	49,730.64	29,422,142.29	23.39%	96,346,647.68	76.61%

9.2 期末上市基金前十名持有人

国富100A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿再保险有限责任公司	6,363,800.00	25.90%
2	中欧盛世-广发银行-中欧盛世-利可5号资产管理计划	3,614,975.00	14.71%
3	中国大地财产保险股份有限公司	2,268,753.00	9.23%
4	陈洲	1,466,200.00	5.97%
5	泰康人寿保险股份有限公司-分红-个人分红-019L-FH002深	946,199.00	3.85%
6	富安达基金-民生银行-复熙稳赢1号资产管理计划	900,900.00	3.67%
7	闫改英	870,600.00	3.54%
8	富安达基金-光大银行-富安达-利可1号资产管理计划	838,055.00	3.41%
9	赵丽	701,227.00	2.85%
10	中国银河证券股份有限公司	605,500.00	2.46%

国富100B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	张美芳	4,490,000.00	18.27%
2	项燕	2,614,917.00	10.64%
3	张卫国	2,045,477.00	8.32%
4	陈丽	780,206.00	3.17%
5	尉睦金	757,000.00	3.08%
6	张玲	504,300.00	2.05%
7	宛崇燕	474,700.00	1.93%
8	莫家秀	320,000.00	1.30%
9	林少逸	317,206.00	1.29%
10	翟罗根	300,000.00	1.22%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国富100A	—	—
	国富100B	—	—
	国富100	99,016.65	0.129230%
	合计	99,016.65	0.078729%

9.4 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	份额级别	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	国富100A	0
	国富100B	0
	国富100	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放 式基金	国富100A	0
	国富100B	0
	国富100	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	国富100A	国富100B	国富100
基金合同生效日(2015年03月26日)基金份额总额	117,906,583.00	117,906,584.00	439,642,401.42
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	—	—	244,004,996.39
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	—	—	793,691,774.84
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-93,332,458.00	-93,332,458.00	186,664,916.00
本报告期期末基金份额总额	24,574,125.00	24,574,126.00	76,620,538.97

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§ 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) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015年4月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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67000.00元，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。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国海证券	2	643,032,738.85	42.98%	581,801.07	42.89%	
中泰证券	1	314,643,420.54	21.03%	286,830.92	21.14%	
银河证券	1	240,597,373.17	16.08%	219,039.95	16.15%	

申万宏源	2	184,292,432.7	12.32%	166,281.29	12.26%	
兴业证券	1	60,004,386.81	4.01%	53,157.2	3.92%	
长江证券	2	29,159,343.77	1.95%	27,156.24	2%	
国信证券	1	10,780,013	0.72%	10,039.5	0.74%	
广发证券	1	5,697,121.18	0.38%	5,191.8	0.38%	
华创证券	1	3,483,143.7	0.23%	3,174.17	0.23%	
光大证券	1	3,463,997	0.23%	3,226.16	0.24%	
海通证券	2	825,492.15	0.06%	750.54	0.06%	
东方证券	2	—	—	—	—	
中信证券	1	—	—	—	—	
中金公司	2	—	—	—	—	
中银国际	1	—	—	—	—	
中信建投	2	—	—	—	—	
招商证券	1	—	—	—	—	
华泰证券	1	—	—	—	—	
瑞银证券	1	—	—	—	—	
民生证券	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：

- 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变更情况

报告期内，本基金新增广发证券深圳交易单元1个；新增长江证券深圳交易单元1个；减少广发证券 上海交易单元1个；减少东海证券上海交易单元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
国海证券	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	675,000,000	100%	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—
中银国际	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
瑞银证券	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—

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	富兰克林国海中证100指数增强型分级基金之份额发售公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-02-26
2	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同摘	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-02-26

	要		
3	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金招募说明书	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-02-26
4	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-02-26
5	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-02-26
6	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金上网发售提示性公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-03-02
7	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金_基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-03-27
8	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
9	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金之国富100A与国富100B基金份额上市交易公告书	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-04-07
10	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金之国富100A与国富100B基金份额上市交易公告书信息更正	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-04-08
11	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金参加部分销售机构电子渠道、基金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	2015-04-08
12	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金开放申购、赎回和定期定额投资业务公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-04-08
13	关于富兰克林国海中证100指数	中国证监会指定报刊及公	2015-04-08

	增强型分级证券投资基金开通跨系统转托管业务的公告	司网站	
14	关于开通富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金份额配对转换业务的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-04-08
15	基金上市交易提示性公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-04-10
16	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
17	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
18	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
19	关于增加农业银行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、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-07-17
20	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、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-07-17
21	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金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
22	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
23	关于增加交通银行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	2015-08-01

	务的公告		
24	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
25	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
26	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
27	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
28	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金2015年半年度报告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-08-28
29	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第三次公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-09-01
30	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
31	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
32	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金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

33	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金更新招募说明书（2015年第1号）及摘要	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-11-06
34	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
35	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
36	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
37	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
38	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
39	富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停申购、赎回、定期定额投资、转托管和配对转换业务的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-12-29
40	国海富兰克林基金管理有限公司关于富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-12-29
41	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金相关业务规则说明的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-12-31
42	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	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-12-31

	行开放式基金申购费率优惠活动的公告		
43	国海富兰克林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
44	关于增加诺亚正行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中证100指数增强型分级证券投资基金设立的文件；
- 2、《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金招募说明书》；
- 4、《富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金托管协议》；
- 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