

富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要 (更新)

编制日期: 2020 年 8 月 24 日

送出日期: 2020 年 8 月 31 日

本概要提供本基金的重要信息, 是招募说明书的一部分。

作出投资决定前, 请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	国富中证100指数增强 (LOF)	基金代码	164508	
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	
基金合同生效日	2015-03-26	上市交易所及上市日期	深圳证券交易所	2020-04-22
基金类型	股票型	交易币种	人民币	
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日	
基金经理	开始担任本基金基金经理的日期		证券从业日期	
张志强	2015-03-26		2002-10-09	
基金转型	根据《基金合同》的有关规定, 本基金基金合同生效满五年后, 即分级运作期届满, 自动转换为上市开放式基金 (LOF), 基金名称变更为“富兰克林国海中证100指数增强型证券投资基金 (LOF)”, 国富中证100 A、国富中证100 B 的基金份额已转换为上市开放式基金 (LOF) 份额。			

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

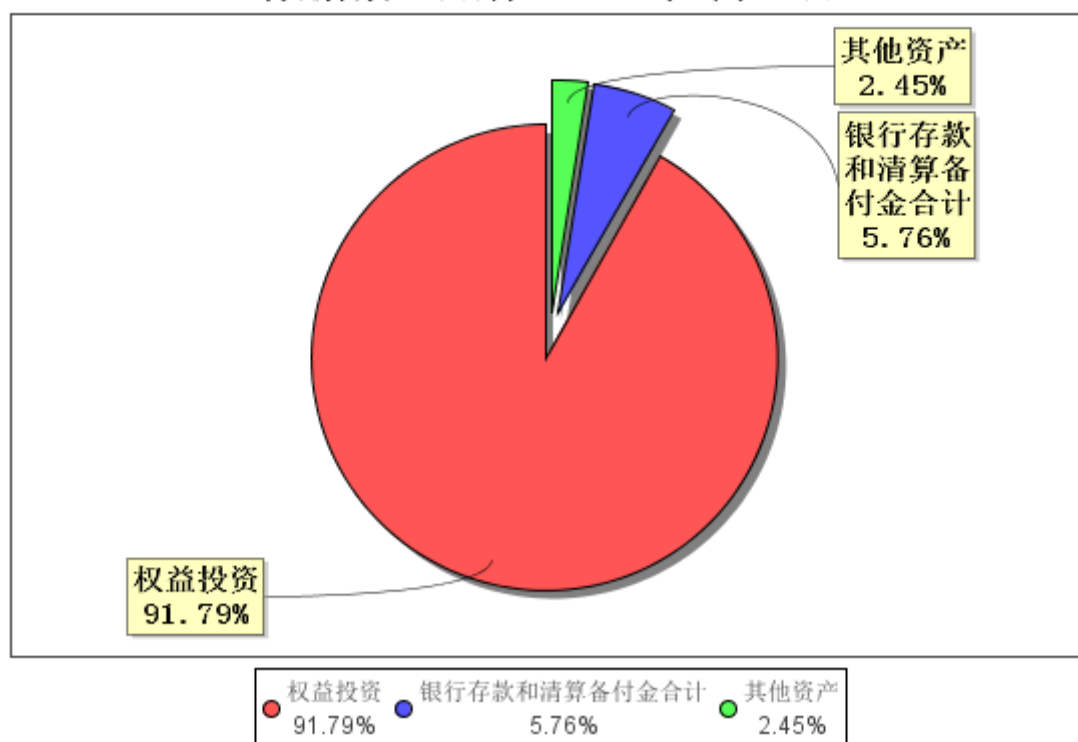
请投资者阅读《招募说明书》第十二章了解详细情况。

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%。
投资范围	本基金投资于具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票 (包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。如果法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他金融工

	具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产净值的比例为90%-95%,其中投资于股票资产的比例不低于基金资产净值的90%,投资于中证100指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产净值的80%;债券、现金以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为5%-10%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
主要投资策略	1、资产配置策略;2、股票投资策略;3、债券投资策略;4、股指期货投资策略。
业绩比较基准	中证100指数收益率*95%+银行同业存款利率*5%
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

(二) 投资组合资产配置图表

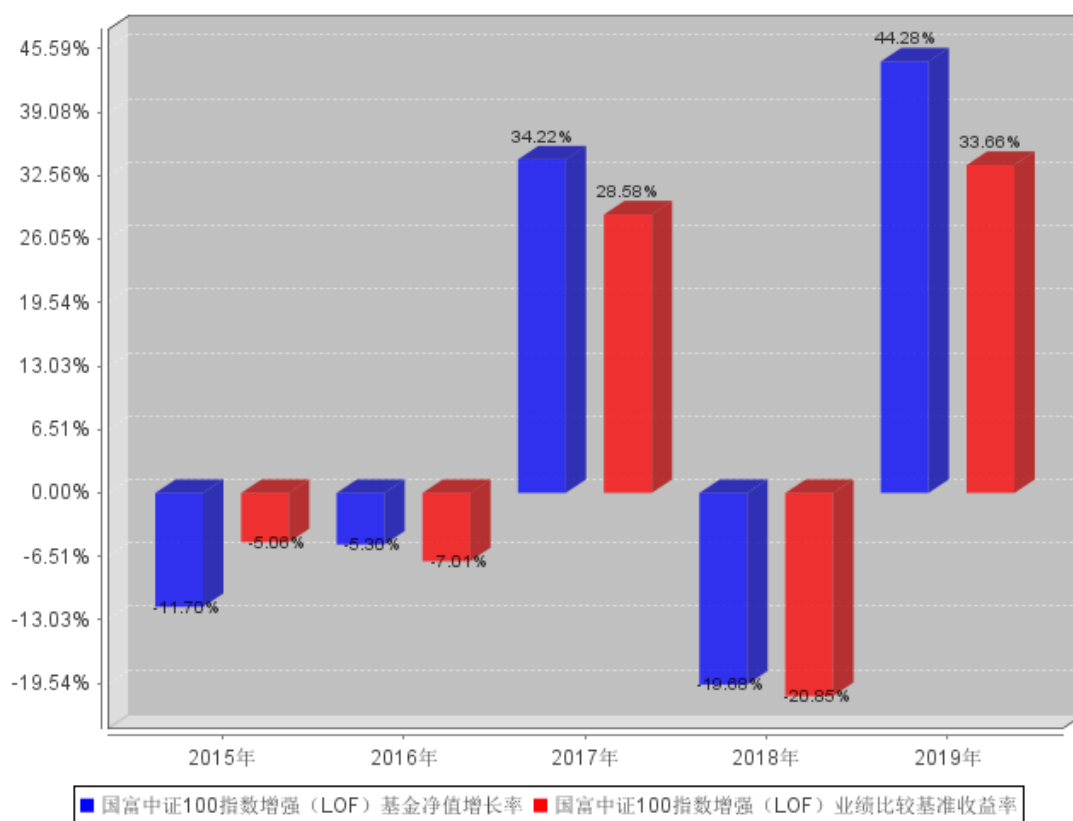
投资组合资产配置图表
数据截止日期: 2020年6月30日



注: 以上为报告期末各资产占基金总资产的比例。

(三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

国富中证100指数增强 (LOF) 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对比图



注:

1. 业绩表现截止日期2019年12月31日。基金过往业绩不代表未来表现;
2. 本基金已在转换基准日2020年3月26日日终转换为上市开放式基金 (LOF), 上图为转换前投资业绩。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
认购费	M < 100 万元	1.00%	本基金的场内认购费率应按照场外认购费率设置
	100 万元 ≤ M < 200 万元	0.60%	-
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.30%	-
	500 万元 ≤ M	1000 元/笔	-
申购费 (前收费)	M < 100 万元	1.20%	本基金的场内申购费率应按照场外申购费率设置
	100 万元 ≤ M < 200 万元	0.80%	

	200万元≤M<500万元	0.40%	率设置
	500万元≤M	1000元/笔	
赎回费	N<7天	1.50%	本基金的场内和场外赎回费不同, 左边为列示的场外赎回费用, 场内赎回费用如下: 1) N<7天, 赎回费率为1.5%; 2) 7≤N, 赎回费率为0.5%。
	7天≤N<365天	0.50%	-
	365天≤N<730天	0.25%	-
	730天≤N	0.00%	-

注: 场内交易费用以证券公司实际收取为准。

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率	
管理费	每日计提, 按月支付	0.85%
托管费	每日计提, 按月支付	0.15%
指数许可使用费	每日计提, 按季支付	0.016%

注:

1、基金的指数许可使用费从基金财产中列支。根据《中证指数公司指数使用许可协议》，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。每日计算，逐日累计。计算方法如下： $H=E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$ ，H为每日应付的指数许可使用费，E为前一日的基金资产净值。自基金合同生效日起，指数许可使用费每季度支付一次，指数许可使用费的收取下限为每季度人民币5万元整（即不足5万元时按照5万元收取）。当年基金合同生效不足一个季度的，按照一个季度收费。

2、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

四、风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

投资于本基金的主要风险：1、市场风险；2、信用风险；3、流动性风险；4、管理风险；5、操作或技术风险；6、合规性风险；7、投资股指期货的风险；8、其他风险；

9、本基金特有风险

(1) 指数投资风险

本基金为股票型指数基金，投资标的为中证100指数，在基金的投资运作过程中可能面临指数基金特有的风险。

1) 标的指数下跌风险

本基金不低于 80% 的股票资产净值将用于跟踪标的指数，业绩表现将会随着标的指数的波动而波动；同时本基金在多数情况下将维持较高的股票仓位，在股票市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

2) 指数增强效果不佳的风险

本基金的指数增强策略可能出现阶段性失效甚至整体失当，导致指数增强组合的累计收益率低于标的指数的累计收益率。

3) 标的指数变更风险

根据基金合同的规定，因标的指数的编制与发布等原因，导致原标的指数不宜继续作为本基金的投资标的指数及业绩比较基准，本基金可能变更标的指数，基金的投资组合将随之调整，基金的收益风险特征可能发生变化，投资者还须承担投资组合调整所带来的风险与成本。

4) 跟踪偏离风险

以下因素可能导致基金投资组合的收益率无法紧密跟踪标的指数的收益率：

① 基金有投资成本、各种费用及税收，而指数编制不考虑费用和税收，这将导致基金收益率落后于标的指数收益率，产生负的跟踪偏离度。

② 指数成份股派发现金红利、新股市值配售收益等因素将导致基金收益率超过标的指数收益率，产生正的跟踪偏离度。

③ 当标的指数调整成份股构成，或成份股公司发生配股、增发等行为导致该成份股在指数中的权重发生变化，或标的指数变更编制方法时，基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异，而且会产生相应的交易成本，导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

④ 投资者申购、赎回可能带来一定的现金流或变现需求，在遭遇标的指数成份股停牌、摘

牌或流动性差等情形时,基金可能无法及时调整投资组合或承担冲击成本,导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

⑤ 在基金进行指数化投资过程中,基金管理人的管理能力,例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等,都会对基金收益产生影响,从而影响基金跟踪偏离度和跟踪误差。

⑥ 其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制,基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同;因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大;因指数发布机构指数编制错误等产生的跟踪偏离度与跟踪误差。

5) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场,标的指数的回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

(2) 科创板股票的特有风险

1) 公司治理风险。科创板股票发行实行注册制,上市条件与主板不同,科创板上市公司的股权激励制度更为灵活,可能存在表决权差异安排。

2) 流动性风险:

由于参与科创板投资有一定的门槛要求,科创板的投资者可能以机构投资者为主。机构投资者在投资决策上具有一定的趋同性,将会造成市场的流动性风险。

科创板可能采用摇号抽签方式对于参与网下申购中签的账户进行获配股份的一定时间内的锁定机制,锁定期期间获配的股份无法进行交易,存在流动性风险。

3) 退市风险。科创板退市的标准、程序和执行较主板更为严格:

① 退市情形更多。当上市公司出现新增市值低于规定标准、信息披露或者规范运作存在重大缺陷的情形,将直接导致退市;

② 退市时间更短。因科创板取消了暂停上市和恢复上市程序,因此存在对应当退市的企业直接终止上市的情形;

③ 执行标准更严。当上市公司明显丧失持续经营能力,仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入时,可能会直接导致退市。

4) 股价波动风险。科创板竞价交易设置较宽的涨跌幅限制,上市后的前5个交易日不设涨跌幅限制,其后涨跌幅限制为 20%。

5) 境外企业风险。在境外注册的红筹企业可以发行股票或存托凭证在科创板上市,其在信

息披露、分红派息等方面可能与境内上市公司存在差异。

6) 存托凭证特别风险。存托凭证代表境外基础证券权益，但持有人并不等同于直接持有境外基础证券。

7) 系统性风险。科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

8) 政策风险。国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

（二）重要提示

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”）经中国证监会证监许可[2012]426号文核准，机构部函[2015]248号文确认，本基金的基金合同于2015年3月26日生效。根据《基金合同》的有关规定，本基金基金合同生效满五年后，即分级运作期届满，自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“富兰克林国海中证100指数增强型证券投资基金（LOF）”，国富中证100 A、国富中证100 B 的基金份额已转换为上市开放式基金（LOF）份额。

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可通过友好协商解决，但若自一方书面提出协商解决争议之日起60日内争议未能以协商方式解决的，则任何一方有权将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站：www.ftsfund.com，客户服务热线：400-700-4518。

（一）基金合同、托管协议、招募说明书

（二）定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告

（三）基金份额净值

（四）基金销售机构及联系方式

（五）其他重要资料

六、其他情况说明

—