

**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**

**2015年06月30日**

**基金管理人：国海富兰克林基金管理有限公司**

**基金托管人：中国银行股份有限公司**

**送出日期：2015年08月28日**

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年3月26日（基金合同生效日）起至6月30日止。

## 1.2 目录

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	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	8
3.3	其他指标.....	9
§4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1	资产负债表.....	13
6.2	利润表.....	15
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4	报表附注.....	17
§7	投资组合报告.....	38
7.1	期末基金资产组合情况.....	38
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3.1	期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	48
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	48
7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	48
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	48
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12	投资组合报告附注.....	49
§8	基金份额持有人信息.....	50
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	51
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
8.4	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.....	52
§9	开放式基金份额变动.....	53
§10	重大事件揭示.....	53
10.1	基金份额持有人大会决议.....	53

10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	53
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4	基金投资策略的改变 .....	54
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	54
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8	其他重大事件 .....	56
§11	备查文件目录 .....	58
11.1	备查文件目录 .....	58
11.2	存放地点 .....	58
11.3	查阅方式 .....	58

## § 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	230,222,841.46		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	国富中证100指数增强分级A	国富中证100指数增强分级B	国富中证100指数增强分级
下属分级基金的基金场内简称	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	67,639,614.00	67,639,615.00	94,943,612.46

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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%。</p>
投资策略	<p>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，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。</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；国富中证100 B份额则表现出高风险、收益相对较高的特征。</p>		
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	<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>

### 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	010-66594942
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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ftsfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街27号投资广场23层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期【2015年03月26日（基金合同生效日）-2015年06月30日】
本期已实现收益	64,505,303.12
本期利润	67,949,168.38
加权平均基金份额本期利润	0.1637
本期基金加权平均净值利润率	14.90%
本期基金份额净值增长率	4.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2015年06月30日）
期末可供分配利润	11,172,802.51

期末可供分配基金份额利润	0.0485
期末基金资产净值	241,395,643.97
期末基金份额净值	1.049
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2015年06月30日）
基金份额累计净值增长率	4.90%

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6月30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—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
过去一个月	-7.82%	3.24%	-6.02%	3.22%	-1.80%	0.02%
过去三个月	5.43%	2.50%	8.04%	2.45%	-2.61%	0.05%
自基金合同生效日起至今（2015年3月26日-2015年06月30日）	4.90%	2.42%	11.87%	2.41%	-6.97%	0.01%

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=中证100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中证100指数，具有较强的代表性。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1日收益率（ $Benchmark_t$ ）按下列公式计算：

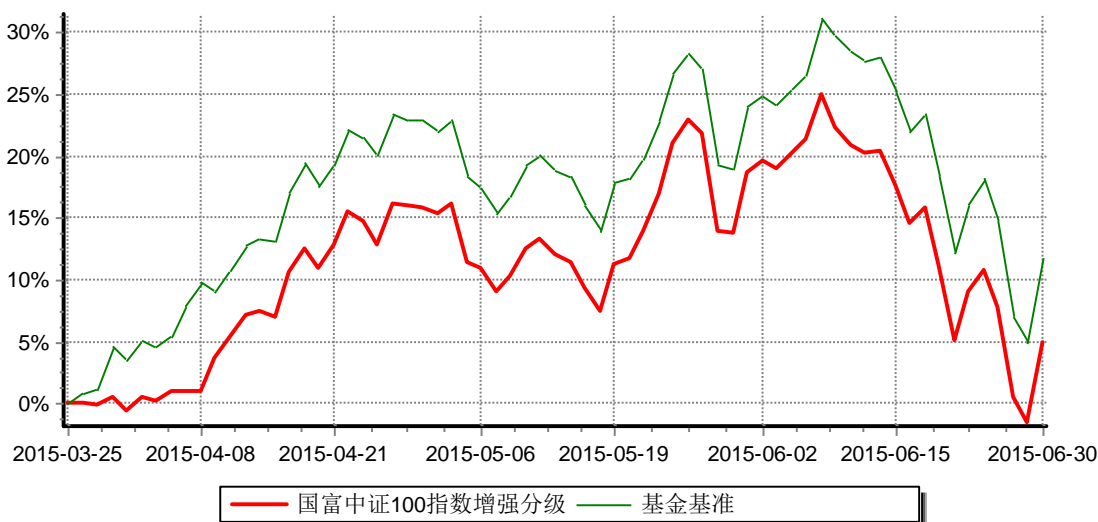
$$Benchmark_t = 95\% \times (\text{中证100指数}_t / \text{中证100指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times \text{同业存款利率} / 360$$

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



注：本基金基金合同生效日为2015年3月26日。本基金建仓期为6个月，截至报告期末基金尚未完成建仓。

## 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-2015年06月30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	1.016
期末中证100A份额累计参考净值	1.016
期末中证100B份额参考净值	1.082
期末中证100B份额累计参考净值	1.082
中证100A的预计年收益率	6.00%

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国海富兰克林基金管理有限公司成立于2004年11月，由国海证券股份有限公司和富

兰克林邓普顿投资集团全资子公司邓普顿国际股份有限公司共同出资组建，目前公司注册资本2.2亿元人民币，国海证券股份有限公司持有51%的股份，邓普顿国际股份有限公司持有49%的股份。

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张志强	公司量化与指数投资总监, 金融工程部总经理, 职工监事, 国富沪深300指数增强基金及国富中证100指数增强分级基金基金经理	2015年03月26日	—	12年	张志强先生, CFA, 纽约州立大学(布法罗) 计算机科学硕士, 中国科学技术大学数学专业硕士。历任美国Enreach Technology Inc. 软件工程师, 海通证券股份有限公司研究所高级研究员, 友邦华泰基金管理有限公司高级数量分析师, 国海富兰克林基金管理有限公司首席数量分析师、风险控制部总经理、业务发展部总经理。截止本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司量化与指数投资总监、金融工程部总经理、国富沪深300指数增强基

					金及国富中证100指数增强分级基金基金经理、职工监事。
--	--	--	--	--	-----------------------------

注：

1. 表中“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，其中，首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日。
2. 表中“证券从业年限”的计算标准为该名员工从事过的所有诸如基金、证券、投资等相关金融领域的工作年限的总和。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

报告期内公司未发现不同投资组合间通过价差交易进行利益输送的行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年上半年，A股市场持续大幅上涨，直至6月中旬迎来一轮急剧下跌，其中中证100指数上涨17.32%，以创业板股票为代表的新经济等主题股票的涨幅远超大盘蓝筹股。从宏观经济来看，上半年PMI指数缓慢上升，经济呈现低位企稳迹象，但工业景气度仍旧低迷。投资上，固定资产投资增速继续放缓，虽然房地产销售有所反弹，但房地产投资增长继续下滑。消费保持缓慢增长，短期没有显著改观。进出口数据也停留在历史低

位。在经济低迷的情况下，各项政策总体宽松，股票市场的资金供给充裕是促使市场大幅上涨的主要因素之一。在市场大幅上涨的同时，各种非理性投机行为充斥市场，成为6月中旬市场暴跌的主因。

本基金于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，同时通过个股的选择力争获取超越业绩比较基准的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日，本基金份额净值为1.049元。自基金成立至本报告期末，基金份额净值上涨4.90%，同期业绩比较基准上涨11.87%，基金表现落后业绩基准6.97%，年化跟踪误差为10.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司在报告期内有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定设有投资资产估值委员会（简称“估值委员会”），并已制订了《公允估值管理办法》。估值委员会审核和决定投资资产估值的相关事务，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由董事长（本报告期内代为履行总经理职责）或其任命者负责，成员包括投研、风险控制、监察稽核、交易、基金核算方面的部门主管，相关人员均具有丰富的证券基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，应

向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金

报告截止日：2015年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年06月30日
<b>资 产:</b>		
银行存款	6.4.7.1	18,348,461.71
结算备付金		75,618.56
存出保证金		244,418.62
交易性金融资产	6.4.7.2	224,963,576.26
其中：股票投资		224,963,576.26
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	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
应收证券清算款		—
应收利息	6.4.7.5	2,904.02
应收股利		—
应收申购款		5,111,043.27
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		248,746,022.44
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年06月30日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		2,174.02
应付赎回款		6,073,387.00
应付管理人报酬		231,110.42

应付托管费		50,844.30
应付销售服务费		—
应付交易费用	6.4.7.7	803,643.96
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.8	189,218.77
负债合计		7,350,378.47
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	230,222,841.46
未分配利润	6.4.7.10	11,172,802.51
所有者权益合计		241,395,643.97
负债和所有者权益总计		248,746,022.44

注：1.报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.049元，基金份额总额230,222,841.46份。其中：中证100份额净值1.049元，份额总额94,943,612.46份；中证100A份额净值1.016元，份额总额67,639,614.00份；中证100B份额净值1.082元，份额总额67,639,615.00份。

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6月30日。

## 6.2 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）-2015年06月30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） -2015年06月30日
<b>一、收入</b>		71,614,075.16
1.利息收入		212,540.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	166,547.29
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		45,992.76

入		
其他利息收入		—
2.投资收益(损失以“-”填列)		67,025,846.72
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	64,708,516.95
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	—
资产支持证券投资收 益		—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	6.4.7.14	—
股利收益	6.4.7.15	2,317,329.77
3.公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	6.4.7.16	3,443,865.26
4.汇兑收益(损失以“-”号 填列)		—
5.其他收入(损失以“-”号填 列)	6.4.7.17	931,823.13
<b>减: 二、费用</b>		3,664,906.78
1. 管理人报酬		1,191,953.02
2. 托管费		262,229.71
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.18	1,956,282.86
5. 利息支出		—
其中: 卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	6.4.7.19	254,441.19
<b>三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)</b>		67,949,168.38
减: 所得税费用		—
<b>四、净利润(净亏损以“-” 号填列)</b>		67,949,168.38

### 6.3 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）-2015年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2015年03月26日（基金合同生效日）-2015年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	—	67,949,168.38	67,949,168.38
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)	-445,232,726.96	-56,776,365.87	-502,009,092.83
其中：1.基金申购款	217,555,474.08	25,886,005.35	243,441,479.43
2.基金赎回款	-662,788,201.04	-82,662,371.22	-745,450,572.26
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)	230,222,841.46	11,172,802.51	241,395,643.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

吴显玲（董事长，本报告期内  
代为履行总经理职责）

胡昕彦

黄宇虹

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

富兰克林国海中证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]426号文核准《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，机构部函[2015]248

号文确认，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有限公司普华永道中天验字（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，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。

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。本基金的业绩比较基准为：中证100指数。

本财务报表由本基金的基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司于2015年8月26日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《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》、《富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2015年6月30日的财务状况以及2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本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6月30日。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资。

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。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大的事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以

下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

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

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

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

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

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期2015年03月26日（基金合同生效日）-2015年06月30日
活期存款	18,348,461.71
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	18,348,461.71

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2015年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	221,519,711.00	224,963,576.26	3,443,865.26
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	221,519,711.00	224,963,576.26	3,443,865.26

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末2015年06月30日
应收活期存款利息	2,774.47
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	30.18
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	0.46
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	98.91
合计	2,904.02

### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元



项目	本期末2015年06月30日
交易所市场应付交易费用	803,643.96
银行间市场应付交易费用	—
合计	803,643.96

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末2015年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	22,889.58
指数使用费	50,000.00
审计费	23,127.71
信息披露费	93,201.48
合计	189,218.77

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目(国富100)	本期2015年03月26日(基金合同生效日)-2015年06月30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	217,555,474.08	217,555,474.08
本期赎回(以“-”号填列)	-662,788,201.04	-662,788,201.04
本期末	230,222,841.46	230,222,841.46

注：1、本基金的基金份额包括国富100、国富100A份额和国富100B份额。

2、本基金合同于2015年3月26日生效，设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币675,295,672.74元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币159,895.68元，以上收到的实收基金(本息)共计人民币675,455,568.42。

3、国富100基金成立日(2015-03-26)份额为439,642,401.42份，本期增加份额为318,089,412.08份，其中本期申购217,555,474.08份，从国富100A份额及国富100B份额配对转换转入100,533,938.00份；本期减少份额为662,788,201.04份，其中本期赎回662,788,201.04份，期末份额为94,943,612.46份。国富100A基金成立日(2015-03-26)份额为117,906,583.00份，本期国富100A份额配对转换出份额为50,266,969.00份，期末份额为67,639,614.00份。国富100B基金成立日(2015-03-26)份额为117,906,584.00份，本期国富100B份额配对转换出份额为50,266,969.00份，期末份额为

67,639,615.00 份。国富 100 基金份额、国富 100A 份额及国富 100B 份额每份份额面值为 1.00 元。  
 4、国富 100A 份额、国富 100B 份额的本期申购（即配对转换入份额）之和等于国富 100 基金份额配对转换出份额；国富 100A 份额、国富 100B 份额的本期赎回（即配对转换出份额）之和等于国富 100 基金份额配对转换入份额。上述实收基金本期申购及本期赎回中未包括国富 100 基金份额、国富 100A 份额及国富 100B 份额的配对转换金额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期利润	64,505,303.12	3,443,865.26	67,949,168.38
本期基金份额交易产生的变动数	-25,444,866.52	-31,331,499.35	-56,776,365.87
其中：基金申购款	8,901,149.36	16,984,855.99	25,886,005.35
基金赎回款	-34,346,015.88	-48,316,355.34	-82,662,371.22
本期已分配利润	—	—	—
本期末	39,060,436.60	-27,887,634.09	11,172,802.51

#### 6.4.7.11 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）-2015年06月30日
活期存款利息收入	150,938.59
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	13,857.83
其他	1,750.87
合计	166,547.29

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.6.12.1 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）-2015年06月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	64,708,516.95
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	64,708,516.95

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年03月26日（基金合同生效日）-2015年06月30日
卖出股票成交总额	598,789,975.67
减：卖出股票成本总额	534,081,458.72
买卖股票差价收入	64,708,516.95

#### 6.4.7.13 债券投资收益

无。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年03月26日（基金合同生效日）-2015年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,317,329.77
基金投资产生的股利收益	—
合计	2,317,329.77

#### 6.4.7.16 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）-2015年06月30日
1.交易性金融资产	3,443,865.26
——股票投资	3,443,865.26
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	3,443,865.26

#### 6.4.7.17 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）-2015年06月30日
基金赎回费收入	931,823.13
合计	931,823.13

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

#### 6.4.7.18 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）-2015年06月30日
交易所市场交易费用	1,956,282.86
银行间市场交易费用	—
合计	1,956,282.86

#### 6.4.7.19 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）-2015年06月30日
审计费用	23,127.71
信息披露费	93,201.48
银行汇划费用	11,430.22
指数使用费	51,481.78
上市年费	75,000.00
债券账户维护费	—
其他手续费	200.00
合计	254,441.19

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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
国海富兰克林投资管理（上海）有限公司	基金管理人存在控制关系的公司

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2015年03月26日（基金合同生效日）-2015年06月30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	47.96%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年03月26日（基金合同生效日）-2015年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国海证券	581,801.07	47.91%	171,115.80	21.29%

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。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2015年03月26日（基金合同生效日）-2015年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,191,953.02
其中：支付销售机构的客户维护费	299,363.52

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。

##### 6.4.10.2.2 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）-2015年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	262,229.71

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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

- 1.基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。
- 2.本基金基金合同生效日为2015年3月26日，本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

- 1.本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。
- 2.本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。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期2015年03月26日（基金合同生效日）-2015年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	18,348,461.71	150,938.59

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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

报告期【基金合同生效日（2015年3月26日）至2015年6月30日】内本基金未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2015年06月30日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
600886	国投电力	2015-06-24	筹划非公开发行股票事项	14.87			120700	1,395,853.00	1,794,809.00
600900	长江电力	2015-06-15	重大资产重组	14.35			119400	1,343,932.36	1,713,390.00
601111	中国国航	2015-06-30	筹划非公开发行股票事项	15.36	2015-07-29	13.78	81600	850,231.54	1,253,376.00
002353	杰瑞股份	2015-05-27	重大事项停牌	44.35			22100	878,664.98	980,135.00
601633	长城汽车	2015-06-19	筹划非公开发行股票事项	42.76	2015-07-13	38.50	14717	786,333.97	629,298.92

注：本基金截至2015年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理



#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票指数增强型基金，属于较高风险、较高预期收益的证券投资基金。本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他证券品种，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金采用指数增强投资策略。通过量化风险管理方法，控制基金投资组合与标的指数构成的偏差，同时结合主动投资方法，在严格控制跟踪偏离风险的基础上，力争获得超越业绩比较基准标的的投资收益，追求基金资产的长期增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险管理委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险控制部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理，由风险控制部负责投资风险管理及绩效评估。

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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2015年6月30日，基金未持有信用类债券。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合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。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要

为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2015年 06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	18,348,461.71	—	—	—	18,348,461.71
结算备付金	75,618.56	—	—	—	75,618.56
存出保证金	244,418.62	—	—	—	244,418.62
交易性金融资产	—	—	—	224,963,576.26	224,963,576.26
应收利息	—	—	—	2,904.02	2,904.02
应收申购款	—	—	—	5,111,043.27	5,111,043.27
资产总计	18,668,498.89	—	—	230,077,523.55	248,746,022.44
负债					
应付证券清算款	—	—	—	2,174.02	2,174.02
应付赎回款	—	—	—	6,073,387.00	6,073,387.00
应付管理人报酬	—	—	—	231,110.42	231,110.42
应付托管费	—	—	—	50,844.30	50,844.30
应付交易费用	—	—	—	803,643.96	803,643.96
其他负债	—	—	—	189,218.77	189,218.77
负债总计	—	—	—	7,350,378.47	7,350,378.47
利率敏感度缺口	18,668,498.89	—	—	222,727,145.08	241,395,643.97

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2015年06月30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	224,963,576.26	93.19
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	224,963,576.26	93.19

#### 6.4.13.4.3.2 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：人民币万元）	
		本期末	上年度末
	中证100指数下降5%	减少约1059万元	—
	中证100指数上升5%	增加约1059万元	—

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2015年6月30日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为218,592,567.34元，属于第二层次的余额为6,371,008.92元，无属于第三层次的余额。于2015年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债均属于第一层次。

##### (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。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于2015年3月26日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值（附注6.4.5.2），并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2015年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	224,963,576.26	90.44
	其中：股票	224,963,576.26	90.44
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	18,424,080.27	7.41
6	其他各项资产	5,358,365.91	2.15

7	合计	248,746,022.44	100.00
---	----	----------------	--------

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	10,401,169.00	4.31
C	制造业	64,947,211.13	26.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,043,522.72	3.33
E	建筑业	11,858,548.15	4.91
F	批发和零售业	2,212,165.80	0.92
G	交通运输、仓储和邮政业	5,682,528.00	2.35
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,674,619.00	1.94
J	金融业	106,676,691.00	44.19
K	房地产业	7,749,926.46	3.21
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	1,505,680.00	0.62
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	223,752,061.26	92.69

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比
----	------	------	----------

			例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,005,475.00	0.42
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	206,040.00	0.09
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	1,211,515.00	0.50

### 7.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	172,800	14,159,232.00	5.87
2	600036	招商银行	559,470	10,473,278.40	4.34



3	601766	中国南车	439,780	8,074,360.80	3.34
4	600016	民生银行	740,400	7,359,576.00	3.05
5	601166	兴业银行	387,600	6,686,100.00	2.77
6	600030	中信证券	239,201	6,436,898.91	2.67
7	600000	浦发银行	379,500	6,436,320.00	2.67
8	601328	交通银行	665,400	5,482,896.00	2.27
9	600837	海通证券	246,000	5,362,800.00	2.22
10	000651	格力电器	73,800	4,715,820.00	1.95
11	000002	万科A	309,600	4,495,392.00	1.86
12	601398	工商银行	822,700	4,343,856.00	1.80
13	601989	中国重工	289,800	4,289,040.00	1.78
14	601668	中国建筑	478,800	3,978,828.00	1.65
15	601169	北京银行	286,500	3,816,180.00	1.58
16	600887	伊利股份	195,608	3,696,991.20	1.53
17	601818	光大银行	674,900	3,617,464.00	1.50
18	600519	贵州茅台	13,723	3,535,730.95	1.46
19	601288	农业银行	897,300	3,328,983.00	1.38
20	601601	中国太保	100,300	3,027,054.00	1.25
21	601390	中国中铁	218,235	2,987,637.15	1.24
22	000001	平安银行	194,060	2,821,632.40	1.17
23	601006	大秦铁路	189,700	2,663,388.00	1.10
24	000333	美的集团	64,600	2,408,288.00	1.00
25	600104	上汽集团	105,500	2,384,300.00	0.99
26	600048	保利地产	205,563	2,347,529.46	0.97
27	601688	华泰证券	100,600	2,326,878.00	0.96
28	601939	建设银行	325,300	2,319,389.00	0.96
29	600015	华夏银行	150,949	2,295,934.29	0.95
30	600028	中国石化	324,800	2,293,088.00	0.95
31	002024	苏宁云商	144,586	2,212,165.80	0.92
32	000166	申万宏源	135,500	2,201,875.00	0.91

33	000776	广发证券	90,000	2,038,500.00	0.84
34	600795	国电电力	285,368	1,989,014.96	0.82
35	600050	中国联通	257,100	1,884,543.00	0.78
36	600999	招商证券	70,600	1,868,076.00	0.77
37	000858	五粮液	57,321	1,817,075.70	0.75
38	600637	百视通	42,900	1,805,232.00	0.75
39	600886	国投电力	120,700	1,794,809.00	0.74
40	002415	海康威视	38,900	1,742,720.00	0.72
41	600518	康美药业	98,200	1,741,086.00	0.72
42	600900	长江电力	119,400	1,713,390.00	0.71
43	600011	华能国际	121,300	1,701,839.00	0.70
44	600276	恒瑞医药	37,510	1,670,695.40	0.69
45	601628	中国人寿	53,200	1,666,224.00	0.69
46	601857	中国石油	144,700	1,639,451.00	0.68
47	601336	新华保险	26,600	1,624,196.00	0.67
48	000625	长安汽车	72,000	1,522,800.00	0.63
49	601186	中国铁建	97,400	1,522,362.00	0.63
50	000725	京东方A	293,200	1,521,708.00	0.63
51	600705	中航资本	65,300	1,511,695.00	0.63
52	000069	华侨城A	116,000	1,505,680.00	0.62
53	000063	中兴通讯	62,700	1,492,887.00	0.62
54	601901	方正证券	125,100	1,487,439.00	0.62
55	601727	上海电气	96,400	1,439,252.00	0.60
56	600010	包钢股份	277,000	1,437,630.00	0.60
57	000538	云南白药	16,606	1,432,599.62	0.59
58	600690	青岛海尔	46,744	1,417,745.52	0.59
59	601669	中国电建	122,600	1,390,284.00	0.58
60	600585	海螺水泥	63,900	1,370,655.00	0.57
61	601899	紫金矿业	264,900	1,356,288.00	0.56
62	600703	三安光电	42,300	1,323,990.00	0.55

63	601088	中国神华	63,200	1,317,720.00	0.55
64	601111	中国国航	81,600	1,253,376.00	0.52
65	600031	三一重工	124,300	1,204,467.00	0.50
66	601788	光大证券	44,600	1,201,970.00	0.50
67	600150	中国船舶	22,508	1,159,162.00	0.48
68	600019	宝钢股份	131,600	1,150,184.00	0.48
69	600111	北方稀土	62,950	1,141,913.00	0.47
70	600583	海油工程	68,100	1,134,546.00	0.47
71	601600	中国铝业	121,500	1,133,595.00	0.47
72	601618	中国中冶	155,500	1,124,265.00	0.47
73	601018	宁波港	125,300	1,107,652.00	0.46
74	600196	复星医药	36,600	1,059,204.00	0.44
75	600535	天士力	20,681	1,029,086.56	0.43
76	600893	中航动力	19,100	1,015,165.00	0.42
77	600406	国电南瑞	47,600	984,844.00	0.41
78	002736	国信证券	39,200	983,528.00	0.41
79	600256	广汇能源	93,300	970,320.00	0.40
80	600958	东方证券	33,700	964,494.00	0.40
81	002304	洋河股份	13,740	953,006.40	0.39
82	600383	金地集团	71,700	907,005.00	0.38
83	601800	中国交建	48,700	855,172.00	0.35
84	002594	比亚迪	15,300	845,019.00	0.35
85	600023	浙能电力	85,128	844,469.76	0.35
86	601998	中信银行	108,200	834,222.00	0.35
87	002241	歌尔声学	22,000	789,800.00	0.33
88	600398	海澜之家	43,000	779,590.00	0.32
89	600309	万华化学	28,277	683,737.86	0.28
90	000895	双汇发展	31,600	674,028.00	0.28
91	601898	中煤能源	58,400	666,928.00	0.28
92	600018	上港集团	83,200	658,112.00	0.27

93	601633	长城汽车	14,717	629,298.92	0.26
94	600372	中航电子	17,200	600,796.00	0.25
95	002252	上海莱士	8,800	575,872.00	0.24
96	601225	陕西煤业	63,900	522,702.00	0.22
97	601808	中海油服	17,900	500,126.00	0.21
98	603288	海天味业	8,680	277,239.20	0.11
99	600485	信威集团	4,800	210,672.00	0.09

### 7.3.2 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	002353	杰瑞股份	22,100	980,135.00	0.41
2	601211	国泰君安	6,000	206,040.00	0.09
3	603589	口子窖	1,000	25,340.00	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	43,335,346.16	17.95
2	600030	中信证券	32,535,330.11	13.48
3	600016	民生银行	31,296,693.00	12.96
4	600036	招商银行	29,885,555.16	12.38
5	601166	兴业银行	25,590,306.20	10.60
6	600837	海通证券	24,547,968.65	10.17
7	600000	浦发银行	21,721,339.12	9.00
8	000002	万科A	14,156,545.17	5.86
9	000651	格力电器	13,441,264.32	5.57
10	601668	中国建筑	13,150,825.00	5.45

11	601328	交通银行	12,119,075.00	5.02
12	600887	伊利股份	11,667,076.91	4.83
13	601818	光大银行	11,380,437.00	4.71
14	601398	工商银行	11,323,838.00	4.69
15	601288	农业银行	11,288,753.00	4.68
16	600519	贵州茅台	11,263,893.76	4.67
17	601601	中国太保	11,092,866.00	4.60
18	000001	平安银行	10,547,361.80	4.37
19	601688	华泰证券	10,481,849.00	4.34
20	000776	广发证券	10,297,844.00	4.27
21	601390	中国中铁	10,228,286.95	4.24
22	600104	上汽集团	9,845,713.01	4.08
23	000166	申万宏源	9,734,561.71	4.03
24	600999	招商证券	9,322,558.36	3.86
25	601989	中国重工	9,155,075.00	3.79
26	601169	北京银行	9,083,877.00	3.76
27	000333	美的集团	8,857,917.00	3.67
28	600048	保利地产	7,955,553.25	3.30
29	601006	大秦铁路	7,915,271.00	3.28
30	600010	包钢股份	7,453,511.68	3.09
31	601901	方正证券	7,383,518.00	3.06
32	601939	建设银行	7,368,454.72	3.05
33	601857	中国石油	7,226,979.00	2.99
34	002024	苏宁云商	6,887,168.00	2.85
35	600015	华夏银行	6,838,914.95	2.83
36	601766	中国中车	6,776,555.00	2.81
37	000725	京东方A	6,685,555.00	2.77
38	601186	中国铁建	6,644,865.00	2.75
39	600900	长江电力	6,585,096.00	2.73
40	601628	中国人寿	6,561,221.57	2.72

41	600518	康美药业	6,479,483.00	2.68
42	600028	中国石化	6,191,368.00	2.56
43	600050	中国联通	6,110,855.00	2.53
44	601299	中国北车	5,950,279.00	2.46
45	600795	国电电力	5,642,700.37	2.34
46	000858	五 粮 液	5,577,226.99	2.31
47	600031	三一重工	5,440,327.00	2.25
48	600637	东方明珠	5,431,516.48	2.25
49	600585	海螺水泥	5,410,054.00	2.24
50	600111	北方稀土	5,368,060.35	2.22
51	600383	金地集团	5,291,833.19	2.19
52	000063	中兴通讯	5,238,810.00	2.17
53	000157	中联重科	5,235,399.05	2.17
54	600019	宝钢股份	5,225,543.00	2.16
55	600690	青岛海尔	4,945,049.92	2.05
56	601088	中国神华	4,909,847.32	2.03
57	601899	紫金矿业	4,860,060.00	2.01
58	600011	华能国际	4,828,464.00	2.00

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	32,066,767.26	13.28
2	600016	民生银行	25,813,583.02	10.69
3	600030	中信证券	25,291,029.78	10.48
4	600036	招商银行	23,741,734.82	9.84
5	600837	海通证券	21,255,175.87	8.81
6	601166	兴业银行	19,304,411.26	8.00
7	600000	浦发银行	17,220,084.34	7.13

8	601668	中国建筑	11,769,026.00	4.88
9	000651	格力电器	11,410,883.80	4.73
10	601390	中国中铁	11,308,699.00	4.68
11	600519	贵州茅台	10,180,726.46	4.22
12	000002	万科A	10,165,237.00	4.21
13	600887	伊利股份	9,760,287.03	4.04
14	000001	平安银行	9,541,049.18	3.95
15	601818	光大银行	9,025,819.45	3.74
16	601989	中国重工	8,193,898.00	3.39
17	601288	农业银行	8,176,970.00	3.39
18	601328	交通银行	8,145,035.00	3.37
19	601601	中国太保	7,935,455.40	3.29
20	000776	广发证券	7,871,771.00	3.26
21	601398	工商银行	7,794,167.00	3.23
22	600999	招商证券	7,729,619.00	3.20
23	000166	申万宏源	7,719,007.00	3.20
24	601688	华泰证券	7,589,689.00	3.14
25	600104	上汽集团	7,280,512.76	3.02
26	000333	美的集团	6,752,789.92	2.80
27	601006	大秦铁路	6,744,987.39	2.79
28	601169	北京银行	6,686,325.00	2.77
29	600050	中国联通	6,303,785.68	2.61
30	600048	保利地产	6,262,145.73	2.59
31	601186	中国铁建	6,040,828.18	2.50
32	601901	方正证券	5,943,091.00	2.46
33	600010	宝钢股份	5,905,701.32	2.45
34	601857	中国石油	5,898,620.14	2.44
35	600900	长江电力	5,867,955.83	2.43
36	000725	京东方A	5,803,202.00	2.40
37	000157	中联重科	5,780,719.81	2.39

38	601939	建设银行	5,765,961.75	2.39
39	600015	华夏银行	5,762,248.00	2.39
40	002024	苏宁云商	5,732,597.00	2.37
41	600518	康美药业	5,572,697.98	2.31
42	600383	金地集团	5,333,852.60	2.21
43	600795	国电电力	5,332,559.67	2.21
44	000063	中兴通讯	4,864,738.00	2.02

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	748,934,278.72
卖出股票收入（成交）总额	598,789,975.67

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。

### 7.5 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

根据基金合同，本基金不投资贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。



## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金本期投资的前十名证券中，报告期内发行主体被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况说明如下：

中信证券股份有限公司（以下简称“公司”或“中信证券”）于2015年1月19日公告因存在未到期融资融券合约展期的问题（根据相关规定，融资融券合约期限最长为6个月），公司被中国证券监督管理委员会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。对此，公司已采取以下整改措施：

1、暂停新开立融资融券客户信用账户3个月。

2、自2015年1月16日起，公司将不允许新增任何新的合约逾期，距合约到期两周前将反复提醒客户及时了结合约，对于到期未了结的合约将强制平仓。

3、在监管规定的时间内，清理完成旧的逾期合约。

4、将融资融券业务客户开户条件由客户资产满人民币30万元提高到客户资产满人民币50万元。

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

海通证券股份有限公司（以下简称“公司”或“海通证券”）于2015年1月20日公告2015年1月16日中国证券监督管理委员会公开通报2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况。公司因存在违规为到期融资融券合约展期问题，受到暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。经查，公司存在为少数融资融券六个月到期并提出逾期负债暂缓平仓申请的客户，在维持担保比例处于150%以上的前提下暂缓平仓的行为，这部分客户数占公司融资融券交易的总客户数不到1%。

目前公司已经采取了以下整改措施：一是暂停新开立客户信用账户三个月；二是不允许有任何新的合约逾期，合约到期前将按合同规定提醒客户及时了结合约，到期未了结将会执行强制平仓；三是按监管要求限定的期限内完成违规逾期合约的清理；四是认真整改融资融券业务，确保业务的合规经营。

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

金管理人对该股票的投资决策遵循公司的投资决策制度。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	244,418.62
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	2,904.02
5	应收申购款	5,111,043.27
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,358,365.91

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	002353	杰瑞股份	980,135.00	0.41	重大事项停牌

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	334	202,513.81	44,051,240.00	65.13%	23,588,374.00	34.87%
国富100B	1,286	52,596.90	4,147,386.00	6.13%	63,492,229.00	93.87%
国富100	2,244	42,309.99	8,432,886.00	8.88%	86,510,726.46	91.12%
合计	3,864	59,581.48	56,631,512.00	24.60%	173,591,329.46	75.40%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号(国富100A)	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	富安达基金-海通证券-富安达-元普量化对冲1号资产管理计划	7,214,660.00	10.67%
2	中国人寿再保险股份有限公司	6,363,800.00	9.41%
3	海康人寿保险有限公司	5,783,446.00	8.55%
4	中国银河证券股份有限公司	4,710,221.00	6.96%
5	富安达基金-光大银行-富安达-利可1号资产管理计划	3,917,600.00	5.79%
6	中欧盛世-广发银行-中欧盛世-利可5号资产管理计	3,649,975.00	5.40%

	划		
7	涂颂华	3,410,768.00	5.04%
8	中国大地财产保险股份有限公司	2,268,753.00	3.35%
9	中信证券股份有限公司	2,233,050.00	3.30%
10	荣黎明	2,152,868.00	3.18%

序号(国富100B)	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	张美芳	4,805,000.00	7.10%
2	潘美红	2,870,800.00	4.24%
3	项燕	2,614,917.00	3.87%
4	邱绍汉	1,912,400.00	2.83%
5	中欧基金-广发银行-中欧惠远资产管理计划	1,804,007.00	2.67%
6	赵维清	1,800,000.00	2.66%
7	周立新	1,663,900.00	2.46%
8	虞新泉	1,515,500.00	2.24%
9	中信证券股份有限公司	1,261,200.00	1.86%
10	恩珠措姆	1,120,000.00	1.66%

### 8.3 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	99,512.17	0.104812%
	合计	99,512.17	0.043224%

### 8.4 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、基金投资和研发部门负责人持有本	国富100A	0
	国富100B	0

开放式基金	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

## § 9 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	—	—	217,555,474.08
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	—	—	662,788,201.04
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-50,266,969.00	-50,266,969.00	100,533,938.00
本报告期期末基金份额总额	67,639,614.00	67,639,615.00	94,943,612.46

注：1、本基金基金合同生效日为2015年3月26日。

2、拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### (一) 基金管理人重大人事变动

经国海富兰克林基金管理有限公司第四届董事会第十次会议审议通过，毕国强先生不再担任公司总经理，由公司董事长吴显玲女士代为履行总经理职责。相关公告已于2015年4月18日在《中国证券报》和公司网站披露。

(二) 基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

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。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本基金自成立以来对其进行审计的均是普华永道中天会计师事务所, 未曾改聘其他会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

(一) 基金管理人及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。

(二) 基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

**10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况**

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	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	佣金	占当期佣金总量的比例	
国海证券	2	643,032,738.85	47.96%	—	—	—	—	—	—	581,801.07	47.91%	
银河证券	1	240,597,373.17	17.94%	—	—	—	—	—	—	219,039.95	18.04%	
齐鲁证券	1	228,274,350.00	17.03%	—	—	—	—	—	—	207,821.06	17.11%	

		6.42										
申万宏源	2	170,441,975.99	12.71%	-	-	-	-	-	-	153,949.02	12.68%	
兴业证券	1	57,763,284.81	4.31%	-	-	-	-	-	-	51,114.90	4.21%	
海通证券	2	666,599.15	0.05%	-	-	675,000.00	100.00%	-	-	603.23	0.05%	
东方证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
中信建投	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
国信证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
华泰证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
光大证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
长江证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
民生证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
华创证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
东海证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
招商证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
中银国际	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
瑞银证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	

注：1. 专用交易单元的选择标准和程序

1) 选择代理基金证券买卖的证券经营机构的标准

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，并租用其交易单元作为基金的专用交易

单元。选择的标准是：

资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；

财务状况良好，经营行为规范，最近一年未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚；

内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服

务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

## 2) 租用基金专用交易单元的程序

基金管理人根据上述标准考察证券经营机构，考察结果经公司领导审批后，我司与被选中的证券经营机构签订《券商交易单元租用协议》和《研究服务协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。

之后，基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况，根据如下选择标准细化的评价体系，每季度对签约证券经营机构的服务进行一次综合评价：

A 提供的研究报告质量和数量；

B 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；

C 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；

D 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；

E 其他可评价的量化标准。

经过评价，对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留，并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。

交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

## 2、报告期内证券公司基金专用交易单元的租用与变更情况

报告期内，根据上述基金专用交易单元选择标准和程序，本基金逐步租用证券公司的交易单元合计27个：其中中国海证券、中金公司、申万宏源证券、中信建投证券、东方证券和海通证券各2个，光大证券、长江证券、中信证券、银河证券、中银国际证券、齐鲁证券、招商证券、华泰证券、国信证券、瑞银证券、广发证券、东海证券、兴业证券、华创证券和民生证券各1个。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	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要	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-02-26



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指数增强型分级证券投资基金开通跨系统转托管业务的公告	中国证监会指定报刊及公司网站	2015-04-08

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

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准富兰克林国海中证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。

### 11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所并登载于基金管理人网站: [www.ftsfund.com](http://www.ftsfund.com)。

### 11.3 查阅方式

- 1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅，并可按工本费购买复印件。
- 2、登陆基金管理人网站[www.ftsfund.com](http://www.ftsfund.com) 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司

二〇一五年八月二十八日