

基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一二年十月二十五日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事及高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人:中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、持有人名册等数据,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人和基金托管人严格遵循《基金法》及其他有关法律、法规的规定,勤勉尽责地履行各自的职责,但不保证本基金一定盈利。

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。

本报告期中基金费用未审计。

本基金报告期自2012年7月1日起至2012年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:国海富兰克林沪深300指数增强型证券投资基金

基金主代码:450008

交易代码:450008

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2009年9月13日

报告期末基金份额总额:1,018,537,697.22份

本基金采用指数组合投资策略。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度的基础上,力争获得超越业绩比较基准的超额收益,追求超越目标指数的收益。

投资目标 在正常市场情况下,本基金对业绩比较基准的年跟踪误差不超过4%。

资产配置策略:

本基金以追求基金资产长期增长的稳定收益为宗旨,在股票市场上进行指数组合被动投资的基础上,基金管理人在债券(国债、企业债)、股票、现金等各资产类别之间进行适当的主动配置。

通过优化的基金资产配置比例及先进的数学技术,控制与目标的跟踪误差,追求超越目标指数的收益。

股票投资策略:

本基金以指数化投资为主,以最小化跟踪误差为组合的投资控制目标,本基金所规定的指标数为沪深300指数。

本基金在指数化投资的基础上,通过加强操作(优化调整)及一级股票投资,具体而言,基金将基本依据目标指数的成份股权重,并借助数量化选股分析技术构造和调整指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期对投资组合与比较基准的偏离程度,适时对投资组合进行调整,使指数组合化与目标指数的跟踪误差控制在限定的范围内。

在正常市场情况下,本基金的业绩比较基准的年跟踪误差不超过8%。

此外,本基金将利用所持有的股票市值参与一级市场股票投资,以不增加额外风险的前提下提高收益水平,争取获得超越指数的收益。

债券投资策略:

本基金将在宏观审慎经济和资本市场进行研究的基础上,对利率走势、市场走势进行分析和预判,综合考虑国债期货指数成份股的收益率、流动性、波动性的好坏等因素,进行优化选择构建本基金的债券投资组合。

本基金以富兰克林邓普顿集团固定收益类资产投资研究平台及基金经理管理的的投资研究平台为依托,采取积极主动的投资策略,以中长期和趋势分析为主,结合短期周期,宏观经济运行中的风格指数,资金供求关系、政策、货币、财政政策研判及收益曲线变化,在保证流动性和风险可控的前提下,实施积极的债券投资组合管理。

业绩比较基准:95%×沪深300指数+5%×银行同业存款利率

风险收益特征:本基金是股票指数增强型基金,属于较高风险、较高预期收益的证券投资基金。

基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)

1.本期已实现收益 4,487,458.57

2.本期利润 -41,859,008.68

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0428

4.期末基金份额净值 865,096,039.91

5.期末基金份额净值 0.849

注:1.本基金绩效指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,例如,开放式基金的申购赎回费用等。

2.本期已实现收益指基金利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关税费后的余额,本期利润为本期实现收益减去本期公允价值变动收益。

3.基金净值表现指标净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计份额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

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.3 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.4 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.5 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.6 本基金合同生效以来基金累计份额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

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.7 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.8 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.9 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.10 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.11 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.12 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.13 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.14 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.15 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.16 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.17 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.18 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.19 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.20 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.21 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.22 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.23 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.24 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.25 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.26 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.27 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④

过去三个月 -5.14% 1.11% -6.49% 1.13% 1.35% -0.02%

3.2.28 报告期期末按基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率