富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	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,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。		
业绩比较基准	中证100指数		
风险收益特征	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。 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。		
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	010-66594942

2.4 信息披露方式

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

§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

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%

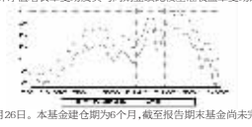
注:根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定,本基金的业绩比较基准=中证100指数×95% + 同业存款利率×5%。本基金股票投资部分的业绩比较基准采用中证100指数,具有较强的代表性。

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(Benchmarkt)按下列公式计算:

Benchmarkt = 95% ×(中证100指数t/中证100指数t-1-1) + 5% ×同业存款利率/360

其中,t=1,2,3,…, 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合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(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遵规守信情况的说明

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》的有关规定,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月中旬迎来一轮急厍下跌,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。进出口数据也仍留在历史低位。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,确保基金估值的公充、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	本期末 2015年06月30日
资 产:	
银行存款	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	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	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	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	-
资产总计	248,746,022.44
负债和所有者权益	本期末 2015年06月30日
负 债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
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	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	189,218.77
负债合计	7,350,378.47
所有者权益:	
实收基金	230,222,841.46
未分配利润	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

资 产	本期2015年03月26日(基金合同生效日)-2015年06月30日
一、收入	71,614,075.16
1.利息收入	212,540.05
其中:存款利息收入	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入	45,992.76
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	64,708,516.95
基金投资收益	-
债券投资收益	-
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	2,317,329.77
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	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)	931,823.13
减:二、费用	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	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	254,441.19
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	67,949,168.38
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	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) 基金管理公司负责人	胡昕庭 主管会计工作负责人	黄宇虹 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675,296,672.74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、卖出股指期货合约的价值,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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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 关联方关系

吴显玲(董事长,本报告期内代为履行总经理职责) 基金管理公司负责人	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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%

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 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。

6.4.8.2 关联方投资

6.4.8.2.1 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。

6.4.8.2.2 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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2015年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 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

股票代码	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	-	-