# 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

**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**
**注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司**
**上市地点:深圳证券交易所**
**上市时间:2015年 4月10 日**
**公告日期:2015年 4月7 日**

## 一、重要声明与提示

《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》(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,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”)管理人国海富兰克林基金管理有限公司(以下简称“本公司”)的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金之国富100A与国富100B基金份额上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在2015年2月26日《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》以及本公司网站(www.ftsfund.com)上的《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》以及同日发布在本公司网站(www.ftsfund.com)上的《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》(以下简称“基金合同”)。

## 二、基金概览

1、 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
2、基金类别:股票型
3、基金运作方式:契约型、开放式
4、本基金的基金份额包括富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金之基础份额(即“国富中证100指数增强分级份额”,以下简称“国富中证100份额”,场内简称“国富100”,基金代码:164508)、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基金份额(即“国富中证100指数增强分级A份额”,以下简称 “国富中证100 A份额”,场内简称 “国富100A”,基金代码:150135)与富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金之积极收益类基金份额(即“国富中证100指数增强分级B份额”,以下简称 “国富中证100 B份额”场内简称“国富100B”,基金代码:150136)。
5、基金存续期限:不定期。
6、国富中证100A份额、国富中证100B份额与国富中证100份额的资产合并运作。
7、本基金通过场内、场外两种方式公开发售。本基金发售结束后,投资者通过场外认购本基金所获得的全部份额将确认为国富中证100份额。投资者在场内认购的每 2份国富中证100份额在发售结束后按 1:1比例自动转换为1份国富中证100A份额和1份国富中证100B份额。基金合同生效后,投资者认购所得的国富中证100场内份额的自动分离,由基金管理人委托注册登记机构进行,无需基金份额持有人申请。
8、基金合同生效后, 国富中证100份额 (场内简称: 国富100, 基金代码:164508)设置单独的基金代码,只可以进行场内与场外的申购和赎回,但不上市交易。国富中证100A份额(场内简称:国富100A;交易代码:150135)与国富中证100B份额(场内简称:国富100B;交易代码:150136)只可在深圳证券交易所上市交易,不可单独进行申购或赎回。
9、国富中证100份额的申购与赎回:本基金的基金合同生效后的分级运作期内,投资者可选择在场外或场内申购和赎回国富中证100份额 (场内简称: 国富100,基金代码:164508)。投资者办理国富中证100份额场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且具有场内基金申购赎回资格的深圳证券交易所会员单位。投资者办理国富中证100份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和基金管理人委托的场外代销机构。本基金的国富中证100A份额与国富中证100B份额不接受投资者的申购与赎回。
10、场内份额配对转换:场内份额配对转换是指本基金的国富中证100份额与国富中证100A份额、国富中证100B份额之间的配对转换,包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每两份国富中证100份额的场内份额申请转换成一份国富中证100A 份额和一份国富中证100B份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每一份国富中证100 A 份额和每一份国富中证100B份额申请转换成两份国富中证100份额的场内份额的行为。
11、基金份额折算:基金份额定期折算的频率为每年折算 1次。基金份额不定期折算的条件是当国富中证100份额的基金份额净值大于或等于2.000元; 当国富中证100B份额的基金份额参考净值小于或等于0.250元。有关基金份额折算的约定,参见基金合同“二十一、分级运作期内基金份额折算”。定期折算基准日或不定期折算基准日的具体日期,详见基金管理人届时发布的公告。
12、基金份额总额:截至2015年4月2日,本基金的份额总额为675,455,568.42份;其中, 国富中证100份额为 439,642,401.42 份; 国富中证100A份额为117,906,583.00 份;国富中证100B份额为117,906,584.00份。
13、基金份额净值:截至2015年4月2日,国富中证100份额的基金份额净值为1.002 元,国富中证100A份额的基金份额净值为1.001元,国富中证100B份额的基金份额净值为1.003元。
14、本次上市交易的基金份额场内简称及交易代码:场内份额简称:国富100A,交易代码:150135;场内份额简称:国富100B,交易代码:150136。
15、本次上市交易份额:国富100A:117,906,583.00份;国富100B:117,906,584.00份
16、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
17、上市交易日期:2015年4月10日
18、基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司
19、基金托管人:中国银行股份有限公司
20、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

## 三、基金的募集与上市交易

(一)富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金上市前募集情况
1、本基金发售申请的核准机构和核准文号:中国证监会证监许可【2012】426号
2、发售日期:2015年3月2日至2015年3月20日
3、发售面值:1.00 元人民币
4、发售方式:场内、场外认购
5、发售机构:
(1)场内发售机构
场内销售机构为具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。
(2)场外发售机构
本基金的场外销售机构包括直销机构和代销机构。其中直销机构是指国海富兰克林基金管理有限公司(以下简称“本公司”),代销机构包括:中国银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、国海证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、东北证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、中信证券(浙江)有限责任公司、安信证券股份有限公司、天相投资顾问有限公司、上海证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、江海证券有限公司、东海证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、上海华信证券有限责任公司、中信证券(山东)有限责任公司、中航证券有限公司、华福证券有限责任公司、上海天天基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、和讯信息科技有限公司、万银财富(北京)基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司(排名不分先后)。
6、验资机构名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
7、认购资金总额及入账情况:
本次富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金募集的有效认购户数为5,912 户,净销售金额为人民币675,295,672.74元,认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币159,895.68元。
上述资金中,场内首次发行募集资金为人民币235,813,167.00元,场外首次发行募集资金为人民币439,642,401.42元,分别于 2015年3月25日全额划入本基金通过基金托管人中国银行股份有限公司开立的富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金托管专户。
按照每份基金份额初始面值1.00元计算,本次募集期的募集资金及其利息结转的份额共计675,455,568.42份,已全部计入基金份额持有人基金账户,归基金份额持有人所有。其中,募集期间基金管理人的从业人员认购本基金151,493.64份,占基金总份额比例为 0.02%;本公司运用固有资金认购本基金 0.00 份,占基金总份额比例0.00 %;本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人认购本基金份额总量的数量区间为0万份至10万份(含)。
8、基金备案情况
本基金于2015年3月26日验资完毕,2015年3月26日向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于 2015年3月26日获得书面确认,本基金基金合同自该日起正式生效。
9、基金合同生效日:2015年3月26日。
10、本基金总份额:675,455,568.42 份。
(二)富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金基金份额上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上[2015]122号
2、上市交易日期:2015年4月10日
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
4、场内份额简称:国富100A,交易代码:150135;场内份额简称:国富100B,交易代码:150136
6、本次上市交易份额:国富100A:117,906,583.00 份;国富100B:117,906,584.00份(截至2015年4月2日)
7、基金资产净值的披露:每个工作日的次日公布国富100的基金份额净值、国富100A、国富100B的基金份额参考净值,并在深交所行情发布系统揭示。
8、未上市交易份额的流通规定:对于托管在场内的的国富中证100份额,基金份额持有人可以直接申请场内赎回但不在深圳证券交易所上市交易, 在符合相关办理条件的前提下,将其分拆为国富中证100份额A份额和国富中证100B份额进可上市流通;对于托管在场外的份额,基金份额持有人既可直接申请场外赎回,也可在办理跨系统转托管后通过跨系统转托管转至深圳证券交易所场内后分拆为国富中证100份额A份额和国富中证100B份额即可上市流通。

## 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)持有人户数
截至2015年4月2日,富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金的持有人总户数为5,911户,其中场外持有人总户数为5,066户;国富中证100A分额持有人总户数为 945户,全部为场内持有人;国富中证100B份额持有人总户数为945户, 全部为场内持有人; 国富中证100份额平均每户持有的场外基金份额为86,782.95份,国富中证100A平均每户持有的场内基金份额为139,534.42份,国富中证100B平均每户持有的场内基金份额为139,534.42份。
(二)持有人结构
1、截至2015年4月2日,场内基金份额持有人结构如下:
国富100A: 场内机构投资者持有的基金份额 32,470,329.00份, 占比27.54%;场内个人投资者持有的基金份额 85,436,254.00 份,占比72.46%。
国富100B:场内机构投资者持有的基金份额32,470,335.00份,占比 27.54%;场内个人投资者持有的基金份额 85,436,249.00份,占比72.46%。
2、截至2015年4月2日,基金管理人的从业人员持有本基金的情况如下:

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例(%) |
|---|---|---|---|
| 基金管理公司所有从业人员持有本基金 | 国富中证100份额 | 101,493.64 | 0.02% |
| | 国富100A | 25,000.00 | 0.02% |
| | 国富100B | 25,000.00 | 0.02% |
| | 合计 | 151,493.64 | 0.02% |

截至2015年4月2日,本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0万份至10万份(含);本基金的基金经理未持有本基金。
(三)截至2015年4月2日,国富100A 基金份额前十名持有人情况

| 序号 | 基金份额持有人名称 | 持有份额 | 占场内基金总份额的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 中国银河证券股份有限公司 | 10,000,194.00 | 8.48% |
| 2 | 兴业证券股份有限公司 | 8,500,165.00 | 7.21% |
| 3 | 招商证券股份有限公司 | 7,500,145.00 | 6.36% |
| 4 | 顾云彪 | 6,001,108.00 | 5.09% |
| 5 | 孙金英 | 5,000,924.00 | 4.24% |
| 6 | 中信证券股份有限公司 | 5,000,243.00 | 4.24% |
| 7 | 何怡 | 2,500,462.00 | 2.12% |
| 8 | 张银海 | 2,500,292.00 | 2.12% |
| 9 | 张建勃 | 2,500,146.00 | 2.12% |
| 10 | 陈睿微 | 1,500,277.00 | 1.27% |
| 11 | 许友琴 | 1,500,277.00 | 1.27% |

截至2015年4月2日,场内国富100B基金份额前十名持有人情况

| 序号 | 基金份额持有人名称 | 持有份额 | 占场内基金总份额的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 中国银河证券股份有限公司 | 10,000,194.00 | 8.48% |
| 2 | 兴业证券股份有限公司 | 8,500,165.00 | 7.21% |
| 3 | 招商证券股份有限公司 | 7,500,146.00 | 6.36% |
| 4 | 顾云彪 | 6,001,108.00 | 5.09% |
| 5 | 孙金英 | 5,000,923.00 | 4.24% |
| 6 | 中信证券股份有限公司 | 5,000,243.00 | 4.24% |
| 7 | 何怡 | 2,500,461.00 | 2.12% |
| 8 | 张银海 | 2,500,291.00 | 2.12% |
| 9 | 张建勃 | 2,500,145.00 | 2.12% |
| 10 | 陈睿微 | 1,500,277.00 | 1.27% |
| 11 | 许友琴 | 1,500,277.00 | 1.27% |

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制

## 五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1、基本情况
名称:国海富兰克林基金管理有限公司
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
办公地址:上海浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期9层
法定代表人:吴显玲
成立日期:2004年11月15日
电话:021-3855 5555
传真:021-6887 0708
联系人:沈增
注册资本:2.2 亿元人民币
股权结构(截止于2015年4月2日):

| 股东名称 | 出资比例(%) |
|---|---|
| 国海证券股份有限公司 | 51% |
| 邓普顿国际股份有限公司 | 49% |
| | |

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会讨论与投资相关的事务,并对重大投资决策做出决定。风险控制委员会行使制订公司的业务风险管理政策和组织实施方案等职权。
公司目前下设15个部门、三个分公司和一个子公司,分别是投资管理部、资产管理部、研究分析部、中央交易室、金融工程部、风险控制部、业务发展部、机构业务部、零售业务部、基金市场部、客户服务部、基金事务部、信息技术部、监察稽核部、行政管理部、上海分公司、深圳分公司、北京分公司、国海富兰克林资产管理(上海)有限公司。投资管理部主要负责基金资产的具体投资运作;资产管理部主要负责公司专户理财的投资业务,协助挖掘潜在客户并进行具体的帐户投资管理业务,以完成客户的投资目标;研究分析部是公司的基础研究部门,主要负责收集、分析各类政治、经济与行业信息,研究宏观经济、资本市场、行业及上市公司的情况,为基金的投资决策提供建议和依据;中央交易室是公司投资决策的执行和监督部门;金融工程部是公司投资研究体系下, 负责指数及其他量化产品的投研工作的职能部门; 风险控制部是负责公司旗下基金和其他资产管理产品或计划的投资风险管理和控制的职能部门;业务发展部是负责公司发展战略研究、业务开拓、产品研发管理的业务部门;机构业务部是负责机构客户的开发、维护和服务的业务部门;零售业务部是从事渠道销售支持的业务部门;基金市场部是负责从事市场推广、品牌建设、对外交流、网站规划、电子商务的职能部门;客户服务部是从事客户服务的业务部门;基金事务部包括注册登记小组、资金清算和基金核算小组两个业务小组;信息技术部是为保障公司日常经营正常运转提供信息系统支持的职能部门; 监察稽核部是公司内部行使监察稽核职能的部门,独立于所有的业务部门,直接对董事会负责,向中国证监会和董事会报告,在业务上接受督察长的指导;行政管理部全面负责公司的行政后勤、人力资源、财务、自有资产管理等工作;上海分公司主要负责华东地区的渠道销售,维护客户等职能;深圳分公司主要负责华南地区的渠道销售,维护客户等职能;北京分公司主要负责北方地区的渠道销售,维护客户等职能;国海富兰克林资产管理(上海)有限公司经营特定客户资产管理以及中国证监会认可的其他业务。
截止到2015年4月2日,公司有员工125人,其中46%以上具有硕士以上学历。
3、本基金基金经理
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。现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指数增强基金基金经理、国富中证100指数增强型分级基金基金经理、职工监事。
(二)基金托管人
1、基本情况
名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)
住所:北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:田国立
成立日期:1983年10月31日
批准设立机关和批准设立文号:国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》(国发[1983]146号)
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整
存续期间:持续经营
联系电话:95566
传真:010-66594942
联系人:王永民
作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。
2、主要人员情况
中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。
3、基金托管业务经营情况
截至2014年12月31日,中国银行已托管307只证券投资基金,其中境内基金282只,QDII基金25只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。
(三)基金验资机构
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6楼
办公地址:上海湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨经信
经办注册会计师:单峰、沈兆杰
联系人:沈兆杰
电话:021-6123 8888
传真:021-6123 8800

## 六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

## 七、基金财务状况

深圳证券交易所在本基金募集期间未收取任何费用,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。
本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金2015年4月2日资产负债表如下:
(除特别注明外,金额单位为人民币元)

| 资 产 | 本期末 2015年4月2日 |
|---|---|
| 资 产: | |
| 银行存款 | 134,607,422.48 |
| 结算备付金 | 7,188,988.05 |
| 存出保证金 | 519,695.93 |
| 交易性金融资产 | 534,974,489.70 |
| 其中:股票投资 | 534,974,489.70 |
| 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 | 77,884.44 |
| 应收股利 | - |
| 应收申购款 | - |
| 递延所得税资产 | - |
| 其他资产 | 7,904.98 |
| 资产总计 | 677,376,385.58 |
| **负债和所有者权益** | **本期末 2015年4月2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 | - |
| 应付赎回款 | - |
| 应付管理人报酬 | 37,019.44 |
| 应付托管费 | 8,144.27 |
| 应付销售服务费 | - |
| 应付交易费用 | 482,804.38 |
| 应交税费 | - |
| 应付利息 | - |
| 应付利润 | - |
| 递延所得税负债 | - |
| 其他负债 | 60,186.47 |
| 负债合计 | 588,154.56 |
| 所有者权益: | |
| 实收基金 | 675,455,568.42 |
| 未分配利润 | 1,332,662.60 |
| 所有者权益合计 | 676,788,231.02 |
| 负债和所有者权益总计 | 677,376,385.58 |

## 八、基金投资组合

截至2015年4月2日,富兰克林国海中证100指数增强型分级证券投资基金的投资组合如下:
(一)期末基金资产组合情况
金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 534,974,489.70 | 78.98 |
| | 其中:股票 | 534,974,489.70 | 78.98 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 141,796,410.53 | 20.93 |
| 8 | 其他资产 | 605,485.35 | 0.09 |
| 9 | 合计 | 677,376,385.58 | 100.00 |

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合
1、报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合
注:截至2015年4月2日,本基金未持有积极投资股票。
2、报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 22,923,689.00 | 3.39 |
| C | 制造业 | 138,786,957.73 | 20.51 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,695,891.56 | 1.88 |
| E | 建筑业 | 32,160,748.00 | 4.75 |
| F | 批发和零售业 | 5,408,529.60 | 0.80 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 11,177,564.00 | 1.65 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 6,434,284.00 | 0.95 |
| J | 金融业 | 283,095,938.58 | 41.83 |
| K | 房地产业 | 19,602,439.23 | 2.90 |
| 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 | 2,688,448.00 | 0.40 |
| 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 | 534,974,489.70 | 79.05 |

(三)报告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
1、报告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前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 463,900 | 36,193,478.00 | 5.35 |
| 2 | 600016 | 民生银行 | 2,588,800 | 25,033,696.00 | 3.70 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 1,576,170 | 24,682,822.20 | 3.65 |
| 4 | 600030 | 中信证券 | 706,601 | 23,628,737.44 | 3.49 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 1,091,700 | 19,781,604.00 | 2.92 |
| 6 | 600837 | 海通证券 | 726,400 | 17,833,120.00 | 2.64 |
| 7 | 600000 | 浦发银行 | 1,069,000 | 17,296,420.00 | 2.56 |
| 8 | 000002 | 万 科A | 753,200 | 10,235,988.00 | 1.51 |
| 9 | 601668 | 中国建筑 | 1,346,400 | 10,124,928.00 | 1.50 |
| 10 | 601601 | 中国太保 | 282,200 | 9,597,622.00 | 1.42 |

2、报告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前五名股票投资明细
注:截至2015年4月2日,本基金未持有积极投资股票。
(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:截至2015年4月2日,本基金本报告期末未持有债券。
(五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
注:截至2015年4月2日,本基金未持有债券。
(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
注:截至2015年4月2日,本基金未持有资产支持证券。
(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
注:截至2015年4月2日,本基金未持有权证。
(八)投资组合报告附注
1、申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
中信证券股份有限公司(以下简称“中信证券”)于2015年1月19日公告因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),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,中信证券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,中信证券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入民币30万元提高到客户资产满入民币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,不改公司长期投资价值。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“海通证券”)于2015年1月20日公告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,这部分客户数占海通证券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。
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,不改公司长期投资价值。同时由于我们看好证券行业整体的发展前景向好,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。
2、申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。
截至2015年4月2日,本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。
3、其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 519,695.93 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 77,884.44 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | 7,904.98 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| | 合计 | 605,485.35 |

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:截至2015年4月2日,本基金未持有处于转股期的可转换债券。
5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
(1)期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:截至2015年4月2日,本基金持有的指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。
(2)期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
注:截至2015年4月2日,本基金未持有积极投资股票。

## 九、重大事件揭示

本基金自基金合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

## 十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。
(三) 在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:
(一)严格遵守《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。
(二)根据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查。如发现基金管理人违反《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同、托管协议的规定,将及时通知基金管理人纠正;基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人将及时向中国证监会报告。

## 十二、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅。
(一)中国证监会核准基金募集的文件
(二)《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》
(三)《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》
(四)《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》
(五)法律意见书
(六)基金管理人业务资格批件、营业执照
(七)基金托管人业务资格批件、营业执照

**国海富兰克林基金管理有限公司**
**2015年4月7日**

**附件:基金合同内容摘要**
(一)基金合同当事人及其权利义务
1、基金管理人基本情况
名称:国海富兰克林基金管理有限公司
住所: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
法定代表人:吴显玲
成立日期:2004年11月15日
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:中国证监会证监基金字[2004]145号
经营范围:基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务
组织形式:有限责任公司
注册资本:2.2亿元人民币
存续期间:50年
2、基金管理人的权利
根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:
(1)依法募集基金;
(2)自本基金合同生效之日起,根据法律法规和本基金合同独立运用并管理基金财产;
(3)依照本基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;
(4)销售基金份额;
(5)召集基金份额持有人大会;
(6)依据本基金合同及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
(8)选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;
(9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用;
(10)依据本基金合同及有关法律规定决定基金收益的分配方案;
(11)在本基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;
(12)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
(13)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资;
(14)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
(15)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
(16)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则;
(17)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。
3、基金管理人的义务
根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:
(1)依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
(2)办理基金备案手续;
(3)自本基金合同生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
(7)依法接受基金托管人的监督;
(8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合本基金合同等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;
(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
(10)编制季度、半年度和年度基金报告;
(11)严格按照《基金法》、本基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、本基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;
(13)按本基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;
(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
(15)依据《基金法》、本基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15 年以上;
(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照本基金合同规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;
(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
(20) 因违反本基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
(21)监督基金托管人按法律法规和本基金合同规定履行自己的义务,基金托管人违反本基金合同造成基金财产损失时, 基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;
(23)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,本基金合同不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束30日内退还基金认购人;
(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;
(26)建立并保存基金份额持有人名册;
(27)法律法规及中国证监会规定的和本基金合同约定的其他义务。
4、基金托管人基本情况
名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)
住所:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:田国立
成立日期:1983年10月31日
批准设立机关和批准设立文号:国务院批转中国人民银行《关于改革中国银行体制的请示报告》(国发[1979]72号)
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24号
组织形式:股份有限公司
注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整