

# 富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证 券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 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：2017 年 3 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 2017 年 3 月 23 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 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 3 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	91,924,055.43 份		
基金合同存续期	不定期		
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份额总额	16,508,989.00 份	16,508,990.00 份	58,906,076.43 份

### 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> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金采取指数增强策略。为控制基金的跟踪误差风险，本基金的资产配置将保持与业绩比较基准基本一致，只在股票、债券（主</p>

	<p>要是国债)、现金等各大类资产间进行小幅度的主动调整,追求适度超越业绩比较基准的收益目标。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>为严格控制跟踪误差风险,本基金的股票投资以被动复制跟踪标的指数为主,辅以适度的增强策略。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金债券投资的主要目的是在保证基金资产流动性的前提下,提高基金资产的投资收益。本基金主要投资于信用等级高、流动性好的政府债券、金融债、企业债等。</p> <p>本基金在进行债券组合管理中,将基于对国内外宏观经济形势、国家财政货币政策动向、市场资金流动性等方面的分析,对利率、信用利差变化的趋势进行判断,综合考察债券的投资价值和流动性等因素,构建和调整债券投资组合。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则参与股指期货交易,以提高投资管理效率,降低跟踪误差风险。</p>		
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	<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	国富中证 100B 份额则表现出高风险、收	本基金为股票指数增强型基金,属于较

	益相对稳定的特征。	益相对较高的特征。	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	010-6659 4896
	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	010-6659 4942

### 2.4 信息披露方式

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

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年 3 月 26 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	2014 年
本期已实现收益	-16,235,197.85	51,147,489.07	-
本期利润	-6,833,695.33	37,063,431.17	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0580	0.1540	-
本期基金份额净值增长率	-5.30%	-11.70%	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1591	-0.1166	-
期末基金资产净值	74,743,724.78	111,107,306.23	-
期末基金份额净值	0.813	0.883	-

注：

- 1、本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日，本基金 2015 年度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 12 月 31 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。

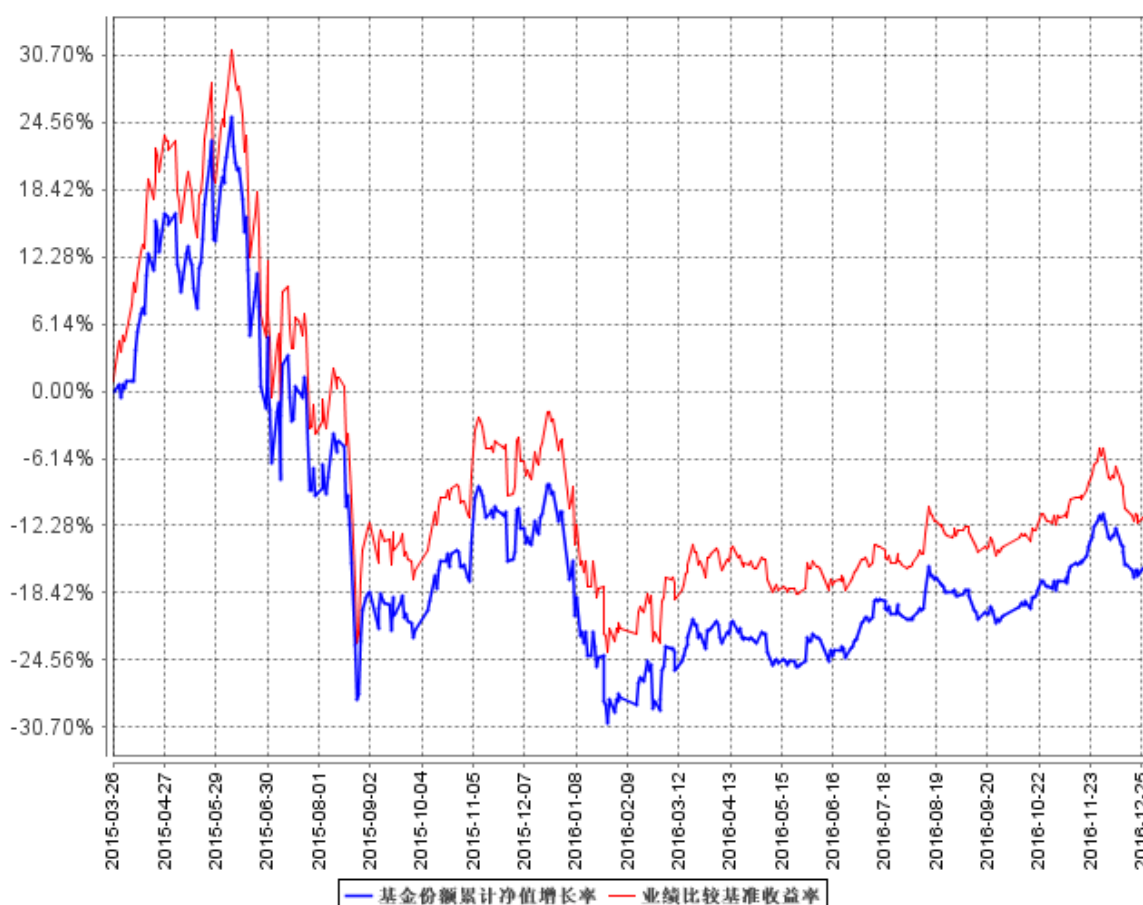
#### 3.2 基金净值表现

##### 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
过去三个月	5.17%	0.66%	2.88%	0.69%	2.29%	-0.03%
过去六个月	8.26%	0.71%	5.63%	0.71%	2.63%	0.00%
过去一年	-5.30%	1.25%	-7.01%	1.19%	1.71%	0.06%
自基金合同 生效起至今	-16.38%	1.89%	-11.72%	1.84%	-4.66%	0.05%

### 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

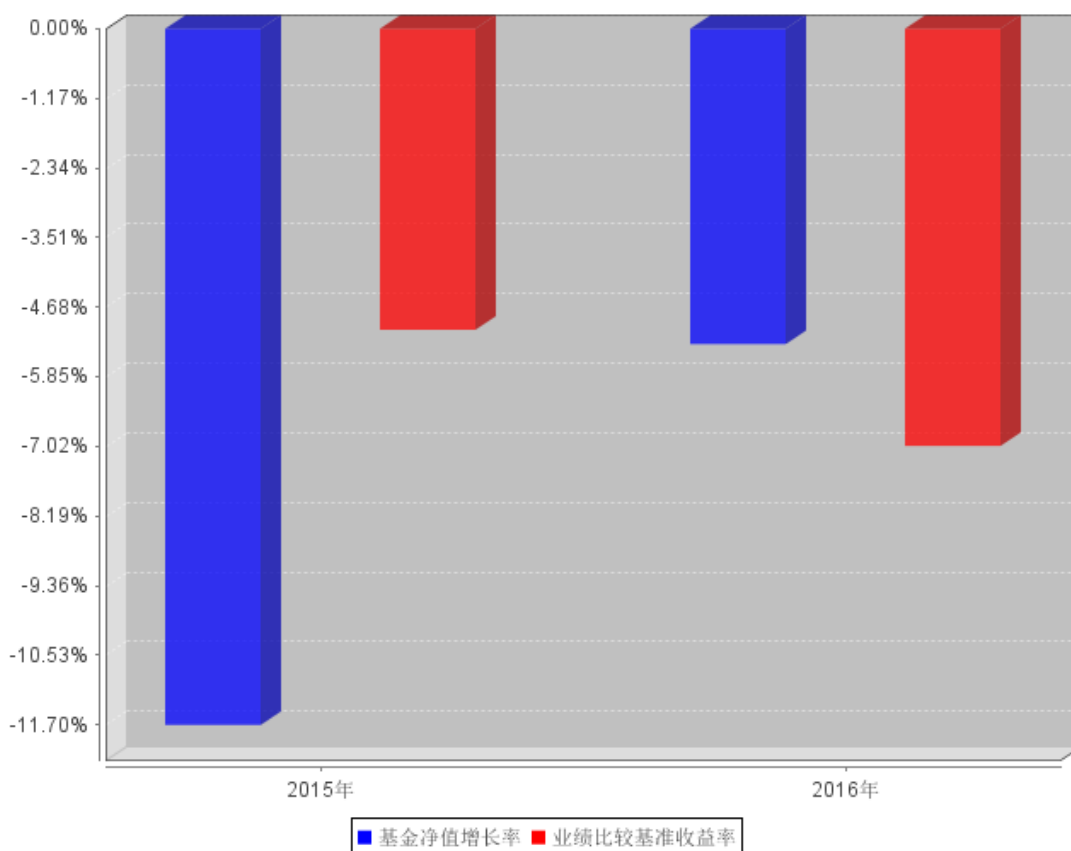
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项投资比  
例符合基金合同约定。

### 3.2.3 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比较

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：

本基金成立于 2015 年 3 月 26 日，故 2015 年的业绩为成立日至年底的业绩而非全年的业绩。

### 3.3 其他指标

其他指标	报告期末（2016 年 12 月 31 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	1.050
期末中证 100A 份额累计参考净值	1.096
期末中证 100B 份额参考净值	0.576
期末中证 100B 份额累计参考净值	0.576
中证 100A 的预计年收益率	0.05

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额	现金形式发	再投资形式发	年度利润配合	备注



	分红数	放总额	放总额	计	
2016	-	-	-	-	
2015	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

注：本基金于 2015 年 3 月 26 日成立。

## § 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 70 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 27 只基金产品（包含 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	2015 年 3 月 26 日	-	14 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

	级基金的 基金经理				析师、风险控制部总经理、业务发展部总经理。截至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、职工监事、国富沪深 300 指数增强基金及国富中证 100 指数增强分级基金的基金经理。
鲍翔	国富沪深 300 指数 增强基金 及国富中 证 100 指 数增强分 级基金的 基金经理 兼高级数 量分析师	2016 年 5 月 5 日	-	7 年	鲍翔先生，英国拉夫堡大学金融数学硕士。历任浙商证券股份有限公司量化研究员及国海富兰克林基金管理有限公司高级数量分析师。截至本报告期末任国海富兰克林基金管理有限公司国富沪深 300 指数增强基金及国富中证 100 指数增强分级基金的基金经理兼高级数量分析师。

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 公平交易制度和控制方法

公司建立了《公平交易管理制度》，确保公司旗下投资组合能够得到公平对待，避免各种投资组合之间的利益输送行为。我们主要从如下几个方面对公平交易进行控制：

1. 在研究信息共享方面，投资研究等部门通过定期的例会沟通机制，就相关议题进行讨论；公司建立了统一的研究平台，研究报告信息通过研究平台进行发布。
2. 建立投资对象备选库，股票及债券的入库需要由研究报告支持作为依据，并经过相关领导审批；建立研究报告的定期更新机制。
3. 在投资决策方面，公司在各类资产管理业务之间建立防火墙，确保业务隔离及人员隔离，同时各投资组合经理投资决策保持独立。
4. 公司对所有投资组合的交易指令实行集中交易，公司在交易系统中设置公平交易功能，按照时间优先、价格优先的原则执行各账户所有指令；公司建立和完善了对债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易分配制度，以确保相关投资组合能够得到公平对待。
5. 公司建立了《同日反向交易管理办法》，通过事前审批来对反向交易进行事前控制。公司每季度对不同时间窗下公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。
6. 公司定期对公平交易执行情况进行监察稽核，并在监察稽核定期报告中做专项说明。公司也会在各投资组合的定期报告中，披露公平交易制度执行情况及异常交易行为专项说明。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内公司严格执行《公平交易管理制度》，明确了公平交易的原则和目标，制订了实现公平交易的具体措施，并在技术上按照公平交易原则实现了严格的交易公平分配。

报告期末，公司共管理了二十七只公募基金及十三只专户产品。统计所有投资组合分投资类别（股票、债券）过去连续 4 个季度内在不同时间窗口（T=1、T=3 和 T=5）存在同向交易价差的

样本，并对差价率均值、交易价格占优比率、t 值、贡献率等指标进行分析，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。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

公司按照《异常交易监控与报告制度》，系统划分了异常交易的类型、异常交易的界定标准、异常交易的识别程序，制订了异常交易的监控办法，并规范了异常交易的分析、报告制度。

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，公司不同投资组合之间未发生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，经公司检查和分析未发现异常情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年初，A 股市场在大跌中开局，其后 A 股市场震荡盘升，上证指数在 2800-3300 点区间呈现窄幅震荡格局。全年而言，价值投资成为市场重要投资主线，其中中证 100 指数下跌 7.50%，以创业板为代表的新兴成长板块跌幅居前，创业板指数下跌 27.71%。

实体经济方面，中国采购经理人 PMI 指数环比持续上升，显示经济景气度回升，经济运行总体向好，制造业企业开工情况继续改善，需求仍旧不错，但企业主动补库存依然较谨慎。12 月份以来市场可能对经济预期有所下调，由于房地产政策重新收紧，相关的投资和消费增速有进一步回落的趋势。流动性方面，在 11、12 月份金融市场经历了流动性收紧的考验，后续考虑到 CPI 维持在 2%左右，通胀压力较小，预计货币政策将保持适度宽松。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.813 元。本报告期，份额净值下跌 5.30%，同期业绩比较基准下跌 7.01%，基金表现超越业绩基准 1.71%，期间基金年化跟踪误差为 2.19%。

## 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 2017 年，经济增长持续放缓的压力仍然存在，房地产、汽车等传统经济领域增速面临一定程度的下滑风险。预计在 2017 年基建仍旧会持续发力维稳，海外经济的起稳复苏或将促使外需出现回暖的迹象。国有经济、供给侧、财税等领域的改革如果取得进展，将扭转房地产、汽车等传统经济领域下滑的顾虑，提升市场的风险偏好，有助于抬升股市的估值水平。流动性方面，预

计在春节以后将出现好转，后期伴随经济下行压力的凸显，而通胀压力较小，预计货币政策将保存适度宽松，配合财政发力。养老金入市和深港通的开通将会给 A 股带来持续可观的增量资金。预计 2017 年市场底部仍将持续抬高，震荡向上的概率较大。

本基金将遵循基金合同的要求，将在保持对业绩基准的跟踪、控制主动投资风险的基础上，借助量化选股策略，力争取得较好的超额收益。

#### **4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况**

报告期内，本基金管理人进一步梳理完善内部相关规章制度及业务流程，严格开展对基金相关法律文件和对外宣传资料的合规审核，积极加强对各部门、各主要运作环节的风险监控，并通过定期稽核和专项稽核，及时发现需要完善的业务环节，并落实措施。报告期内，本基金管理人特别关注基金投资研究交易、市场销售以及运营的合法合规和风险控制，对保护投资者利益涉及的各项业务环节以及信息技术安全开展了专项自查和采取控制措施。同时，本基金管理人开展多层次的员工合规教育和日常提示等措施，强化员工风控意识，努力营造合规经营文化。此外，本基金管理人依照规定，及时向监管部门、董事会报送监察稽核报告。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将继续深入分析和识别市场变化和潜在风险，积极采取措施，加强事前、事中和事后的内部控制，提高监察稽核工作的科学性和有效性。

#### **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”）在对富兰克林国海中证 100 指数增强分级证券投资基金（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《中华人民共和国证券投资基金法》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 审计报告

会计师出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	5,222,433.62	6,348,526.10
结算备付金	227,141.29	50,441.85
存出保证金	20,688.22	176,548.34
交易性金融资产	69,899,460.36	105,097,781.02
其中：股票投资	69,899,460.36	105,097,781.02
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	1,422.23	1,406.88
应收股利	-	-
应收申购款	2,430.31	1,098.68
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-



资产总计	75,373,576.03	111,675,802.87
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016 年 12 月 31 日</b>	<b>2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>		
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	43,928.80	23,576.00
应付管理人报酬	71,432.32	97,472.18
应付托管费	15,715.15	21,443.89
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	108,640.58	38,915.72
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	390,134.40	387,088.85
负债合计	629,851.25	568,496.64
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	89,368,415.30	125,768,789.97
未分配利润	-14,624,690.52	-14,661,483.74
所有者权益合计	74,743,724.78	111,107,306.23
负债和所有者权益总计	75,373,576.03	111,675,802.87

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 91,924,055.43 份。其中富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金之基础份额的份额总额为 58,906,076.43 份，基金份额净值 0.813 元；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份额总额为 16,508,989.00 份，基金份额参考净值 1.050 元；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份额总额为 16,508,990.00 份，基金份额参考净值 0.576 元。

## 7.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 3 月 26 日(基金合同生 效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-4,719,652.15	42,137,789.67
1.利息收入	44,219.21	249,474.52
其中：存款利息收入	44,200.16	203,481.76
债券利息收入	19.05	-
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）	-14,198,200.57	54,887,024.60
其中：股票投资收益	-16,548,992.29	50,757,336.69
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,819.35	-
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	2,344,972.37	4,129,687.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	9,401,502.52	-14,084,057.90
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	32,826.69	1,085,348.45

<b>减：二、费用</b>	2,114,043.18	5,074,358.50
1. 管理人报酬	906,513.27	1,850,900.14
2. 托管费	199,432.97	407,198.08
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	394,361.91	2,236,314.30
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	613,735.03	579,945.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-6,833,695.33	37,063,431.17
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-6,833,695.33	37,063,431.17

### 7.3 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	125,768,789.97	-14,661,483.74	111,107,306.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,833,695.33	-6,833,695.33
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	-36,400,374.67	6,870,488.55	-29,529,886.12

列)			
其中：1. 基金申购款	5,535,434.68	-1,079,169.96	4,456,264.72
2. 基金赎回款	-41,935,809.35	7,949,658.51	-33,986,150.84
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）	89,368,415.30	-14,624,690.52	74,743,724.78
项目	上年度可比期间		
	2015 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 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）	-	37,063,431.17	37,063,431.17
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）	-549,686,778.45	-51,724,914.91	-601,411,693.36
其中：1. 基金申购款	244,004,996.39	22,852,369.93	266,857,366.32
2. 基金赎回款	-793,691,774.84	-74,577,284.84	-868,269,059.68
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）	125,768,789.97	-14,661,483.74	111,107,306.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>          吴显玲          </u>	<u>          吴显玲          </u>	<u>          黄宇虹          </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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]第 426 号《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,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(特殊普通合伙)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 份基金份额,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(以下简称“中国银行”)。

根据《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》和《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》并报中国证监会备案,本基金的基金份额包括确认为富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金之基础份额(以下简称“国富中证 100 份额”),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份额(以下简称“国富中证 100A 份额”)及富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“国富中证 100B 份额”)。其中,国富中证 100A 份额、国富中证 100B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。本基金净资产优先确保国富中证 100A 份额的本金及国富中证 100A 份额累计约定日应得收益,即国富中证 100A 份额为低风险且预期收益相对稳定的基金份额;本基金在优先确保国富中证 100A 份额的本金及累计约定日应得收益后的剩余净资产计为国富中证 100B 份额的净资产,即国富中证 100B 份额为高风险且预期收益相对较高的基金份额。基金发售结束后,场外认购的全部份额将确认为国富中证 100 份额;场内认购的全部份额将按 1:1 的比例确认为国富中证 100A 份额与国富中证 100B 份额。本基金基金合同生效后,国富中证 100 份额与国富中证 100A 份额、国富中证 100B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换,包括基

基金份额的分拆和合并两种转换行为。基金份额的分拆，指基金份额持有人将其持有的国富中证 100 份额按照 2 份场内国富中证 100 份额对应 1 份国富中证 100A 份额与 1 份国富中证 100B 份额的比例进行转换的行为；基金份额的合并，指基金份额持有人将其持有的国富中证 100A 份额与国富中证 100B 份额按照国富中证 100A 份额与 1 份国富中证 100B 份额对应 2 份场内国富中证 100 份额的比例进行转换的行为。

合同生效后，国富中证 100 份额可办理场外与场内申购和赎回，但不上市交易；国富中证 100 A 份额、国富中证 100 B 份额只上市交易，不可单独申购和赎回。本基金的分级运作期为五年（含五年），分级运作期满后，满足基金合同约定的存续条件，本基金无需召开基金份额持有人大会，国富中证 100 A 份额和国富中证 100 B 份额以各自的份额净值为基础，按照国富中证 100 份额的份额净值自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称为“富兰克林国海中证 100 指数增强型证券投资基金（LOF）”。本基金转为上市开放式基金（LOF）后，投资者可通过场内、场外进行基金份额的申购、赎回。

本基金在存续期内的每个会计年度（基金合同生效日所在会计年度除外）第一个工作日对登记在册的国富中证 100 份额、国富中证 100 A 份额进行基金的定期份额折算。国富中证 100 A 份额和国富中证 100 B 份额按照基金合同规定的参考净值计算规则进行计算，对国富中证 100 A 份额的应得收益进行定期份额折算，每 2 份国富中证 100 份额将按 1 份国富中证 100 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，国富中证 100 A 份额和国富中证 100 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。对于国富中证 100 A 份额的约定年化应得收益，即国富中证 100 A 份额每个会计年度 12 月 31 日份额净值超过 1.000 元的部分，将折算为场内国富中证 100 份额分配给国富中证 100 A 份额持有人。当国富中证 100 份额的基金份额净值达到 2.000 元或国富中证 100 B 份额的基金份额参考净值达到 0.250 元时，本基金即可确定折算基准日，进行不定期份额折算。在折算基准日，本基金将对登记在册的国富中证 100 份额、国富中证 100 A 份额和国富中证 100 B 份额分别进行折算。份额折算后本基金将确保国富中证 100 A 份额和国富中证 100 B 份额的比例为 1:1；份额折算后国富中证 100 份额的基金份额净值、国富中证 100 A 份额和国富中证 100 B 份额的参考净值均调整为 1.000 元。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2015]第 122 号文审核同意，投资者场内认购的全部国富中证 100 份额按 1:1 比例自动分拆成的国富中证 100 A 份额和国富中证 100 B 份额于 2015 年 4 月 10 日在深圳证券交易所上市。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

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，本基金作为指数型基金，采用被动复制策略，跟踪标的指数市场表现，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。本基金资产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。本基金投资组合的业绩比较基准为中证 100 指数收益率 $\times$ 95%+银行同业存款利率 $\times$ 5%。

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 2017 年 3 月 23 日批准报出。

#### 7.4.2 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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 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的说明。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 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。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101号《关于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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股票的股息、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。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，暂免征收个人所得税。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。

#### 7.4.7 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、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

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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 3 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
国海证券	-	-	643,032,738.85	42.98%

##### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年3月26日(基金合同生效日)至2015年12月31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	42.89%	-	-

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。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年3月26日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	906,513.27
其中：支付销售机构的客户维护费	201,753.88	431,976.63

注：

1. 支付基金管理人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。

2. 本基金分级运作期届满转换为上市开放式基金 (LOF) 后，管理人报酬的年费率将调整为 0.85%，计提方式不变。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 3 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	199,432.97	407,198.08

注：

1. 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。

2. 本基金分级运作期届满转换为上市开放式基金 (LOF) 后，托管费年费率将调整为 0.15%，计提方式不变。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

	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
基金合同生效日 ( 2015 年 3 月 26 日 ) 持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	12,689,086.29
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	362,545.32
减: 期间赎回/卖出总份额	-	-	13,051,631.61
期末持有的基金份额	-	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-	-

项目	上年度可比期间		
	2015 年 3 月 26 日至 2015 年 12 月 31 日		
	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
基金合同生效日 ( 2015 年 3 月 26 日 ) 持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	12,689,086.29
期间因拆分变动份额	-	-	-
减: 期间赎回/卖出总份 额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	12,689,086.29

期末持有的基金份额	-	-	16.56%
占基金总份额比例			

注：

1. 本基金基金合同生效日为 2015 年 3 月 26 日。
2. 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。
3. 拆分变动份额为本基金定期折算份额。

#### 7.4.8.4.2 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. 本报告期末和上年度末（2015 年 12 月 31 日）除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	5,222,433.62	41,991.28	6,348,526.10	184,964.34

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。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票
----------------------

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股未上市	4.00	4.00	11,986	47,944.00	47,944.00	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股未上市	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股未上市	21.30	21.30	1,240	26,412.00	26,412.00	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股未上市	14.63	14.63	891	13,035.33	13,035.33	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股未上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股未上市	10.44	10.44	904	9,437.76	9,437.76	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股未上市	23.16	23.16	374	8,661.84	8,661.84	-
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股未上市	5.81	5.81	1,213	7,047.53	7,047.53	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配

日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.9.2 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300104	乐视网	2016年12月7日	重大资产重组停牌	35.80	2017年1月16日	36.88	17,200	652,939.00	615,760.00	-
601727	上海电气	2016年8月31日	重大事项停牌	8.42	-	-	46,200	633,263.11	389,004.00	-
002400	省广股份	2016年11月28日	重大事项停牌	13.79	-	-	16,000	211,859.52	220,640.00	-
002151	北斗星通	2016年11月16日	重大资产重组停牌	31.90	2017年1月12日	31.00	5,900	185,222.63	188,210.00	-
002491	通鼎互联	2016年12月22日	重大事项停牌	15.54	2017年1月3日	15.89	7,200	121,532.61	111,888.00	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 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。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.10 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 2016 年 12 月 31 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资产中属于第一层次的余额为 68,213,438.86 元，第二层次的余额为 1,686,021.50 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 99,864,618.06 元，第二层次：5,233,162.96，无属于第三层次的余额)。

(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。

(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 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(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。



## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	69,899,460.36	92.74
	其中：股票	69,899,460.36	92.74
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	5,449,574.91	7.23
7	其他各项资产	24,540.76	0.03
8	合计	75,373,576.03	100.00

注：本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	1,251,984.00	1.68
C	制造业	12,618,006.97	16.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供	2,164,562.04	2.90

	应业		
E	建筑业	3,639,924.00	4.87
F	批发和零售业	518,524.70	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	431,270.00	0.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,370,152.00	1.83
J	金融业	34,161,213.60	45.70
K	房地产业	3,512,911.19	4.70
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	278,000.00	0.37
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	59,946,548.50	80.20

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	808,396.00	1.08
C	制造业	5,900,242.78	7.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	495,933.66	0.66
E	建筑业	15,592.23	0.02

F	批发和零售业	189,098.90	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	665,605.53	0.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	827,093.23	1.11
J	金融业	47,944.00	0.06
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	758,590.53	1.01
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	244,415.00	0.33
S	综合	-	-
	合计	9,952,911.86	13.32

### 8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金未通过沪港通交易机制投资港股。

## 8.3 期末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

### 8.3.1 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	168,700	5,977,041.00	8.00
2	600016	民生银行	449,600	4,082,368.00	5.46
3	601166	兴业银行	252,700	4,078,578.00	5.46
4	600000	浦发银行	193,700	3,139,877.00	4.20

5	601288	农业银行	937,800	2,907,180.00	3.89
6	600837	海通证券	151,100	2,379,825.00	3.18
7	600030	中信证券	145,900	2,343,154.00	3.13
8	000001	平安银行	241,592	2,198,487.20	2.94
9	600015	华夏银行	193,479	2,099,247.15	2.81
10	600519	贵州茅台	6,075	2,029,961.25	2.72

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于国海富兰克林基金管理有限公司网站的年度报告正文。

### 8.3.2 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	002400	省广股份	16,000	220,640.00	0.30
2	600699	均胜电子	5,800	191,922.00	0.26
3	002151	北斗星通	5,900	188,210.00	0.25
4	002085	万丰奥威	9,500	187,720.00	0.25
5	000030	富奥股份	21,500	182,750.00	0.24

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于国海富兰克林基金管理有限公司网站的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	4,985,104.00	4.49
2	601288	农业银行	4,225,236.00	3.80
3	601688	华泰证券	4,077,414.00	3.67

4	600000	浦发银行	3,939,391.00	3.55
5	600030	中信证券	3,752,372.00	3.38
6	601328	交通银行	3,193,022.00	2.87
7	601818	光大银行	3,026,504.00	2.72
8	600015	华夏银行	3,016,080.00	2.71
9	000001	平安银行	3,005,641.00	2.71
10	600837	海通证券	2,988,821.00	2.69
11	000002	万科A	2,987,855.63	2.69
12	601166	兴业银行	2,834,443.00	2.55
13	600061	国投安信	2,757,119.00	2.48
14	601998	中信银行	2,707,547.04	2.44
15	601211	国泰君安	2,307,029.13	2.08
16	600999	招商证券	2,185,603.16	1.97
17	000776	广发证券	2,084,659.00	1.88
18	002736	国信证券	1,989,024.35	1.79
19	601788	光大证券	1,707,502.00	1.54
20	600900	长江电力	1,603,478.00	1.44

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	5,491,832.00	4.94
2	601328	交通银行	5,418,534.00	4.88
3	601818	光大银行	4,276,512.00	3.85
4	600030	中信证券	3,837,571.13	3.45
5	601688	华泰证券	3,615,711.00	3.25

6	600000	浦发银行	3,484,191.00	3.14
7	601998	中信银行	3,431,064.71	3.09
8	601288	农业银行	3,412,773.00	3.07
9	600036	招商银行	3,373,350.40	3.04
10	000776	广发证券	3,290,607.00	2.96
11	600999	招商证券	3,136,418.28	2.82
12	601211	国泰君安	3,012,333.00	2.71
13	600837	海通证券	2,771,102.00	2.49
14	000002	万科A	2,763,028.00	2.49
15	601166	兴业银行	2,580,031.00	2.32
16	601318	中国平安	2,283,909.00	2.06
17	000166	申万宏源	2,168,499.80	1.95
18	000333	美的集团	2,121,770.00	1.91
19	600015	华夏银行	2,083,579.00	1.88
20	601788	光大证券	1,952,806.00	1.76

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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	111,936,874.15
卖出股票收入（成交）总额	139,987,705.04

注：“买入股票成本总额”及“卖出股票收入总额”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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 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。

### 8.11 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。

### 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1 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的，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、处罚的证券如下：**

2016 年 11 月 28 日，海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《行政处罚决定书》（[2016]127 号）。中国证监会对海通证券未按规定审查、了解客户真实身份违法违规行为认定如下：

海通证券上海建国西路营业部和杭州解放路营业部于 2014 年 3 月、2015 年 2 月对杭州恒生网络技术服务有限公司 HOMS 系统开放两条专线接入。对于上述外部接入的第三方交易终端软件，海通证券未进行软件认证许可，未对外部系统接入实施有效管理，未按要求采集客户交易终端信息，未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性，未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息，未实施有效的了解客户身份的回访、检查等程序等行为，违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定。

海通证券宁波百丈东路营业部在明知客户身份存疑的情况下为客户办理有关手续，并且向其他客户推介配资业务。海通证券杭州解放路营业部在 2015 年 4 月明知媒体已报道其客户疑似从事配资业务后，仍未采取有效措施规范该等账户。

依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定，中国证监会决定：对海通证券责令改正，给予警告，没收违法所得 28,653,000 元，并处以 85,959,000 元罚款。

目前，海通证券已按照监管要求完成了整改；同时，海通证券对涉及此案所得和处罚金额已于 2015 年度全额计入损益。因此，海通证券认为本次《行政处罚决定书》对海通证券 2016 年及未来财务无重大影响。此案的了结，消除了海通证券面临的不确定性，有利于海通证券未来发展。

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，不改变海通证券长期投资价值。同时由于本基金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。

**8.12.2 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。**

### 8.12.3 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	20,688.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,422.23
5	应收申购款	2,430.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,540.76

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 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。



**8.12.5.2 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	002400	省广股份	220,640.00	0.30	重大事项停牌
2	002151	北斗星通	188,210.00	0.25	重大资产重组停牌

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
国富中证 100 指数增强分级 A	87	189,758.49	13,817,589.00	83.70%	2,691,400.00	16.30%
国富中证 100 指数增强分级 B	586	28,172.34	243,449.00	1.47%	16,265,541.00	98.53%
国富中证 100 指数增强分级	1,619	36,384.23	129,644.00	0.22%	58,776,432.43	99.78%
合计	2,292	40,106.48	14,190,682.00	15.44%	77,733,373.43	84.56%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

国富中证 100 指数增强分级 A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	泰康人寿保险股份有限公司-分红-个人分红-019L-FH002 深	2,830,063.00	17.14%
2	太平洋资管-建设银行-太平洋智选债基 FOF 型产品	2,784,418.00	16.87%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司-	2,736,232.00	16.57%

	分红-个人分红		
4	太平洋资管-工商银行-东兴证券股份有限公司	2,427,513.00	14.70%
5	太平洋资产-工商银行-南方资本管理有限公司	1,564,800.00	9.48%
6	闫改英	1,248,752.00	7.56%
7	沈芳	521,151.00	3.16%
8	泰康人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品-019L-CT001	484,500.00	2.93%
9	中国太保集团股份有限公司-本级-集团自有资金-012G-ZY001	216,700.00	1.31%
10	北京洲通投资技术研究所	200,000.00	1.21%
11	中国太平洋人寿保险股份有限公司-万能-个人万能	200,000.00	1.21%

## 国富中证 100 指数增强分级 B

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	项燕	2,614,917.00	15.84%
2	张卫国	2,245,477.00	13.60%
3	张玲	504,300.00	3.05%
4	曾庆梅	333,500.00	2.02%
5	林少逸	319,106.00	1.93%
6	翟罗根	300,000.00	1.82%
7	莫家秀	270,000.00	1.64%
8	肖华	257,000.00	1.56%
9	邹璞如	207,600.00	1.26%
10	北京洲通投资技术研究所	200,099.00	1.21%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

## 9.4 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的情况

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	国富中证 100 指数增	0

投资和研究部门负责人持有本开放式基金	强分级 A	
	国富中证 100 指数增强分级 B	0
	国富中证 100 指数增强分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国富中证 100 指数增强分级 A	0
	国富中证 100 指数增强分级 B	0
	国富中证 100 指数增强分级	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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
基金合同生效日（2015 年 3 月 26 日）基金份额总额	117,906,583.00	117,906,584.00	439,642,401.42
本报告期期初基金份额总额	24,574,125.00	24,574,126.00	76,620,538.97
本报告期基金总申购份额	-	-	5,692,677.80
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	43,130,852.86
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-8,065,136.00	-8,065,136.00	19,723,712.52
本报告期期末基金份额总额	16,508,989.00	16,508,990.00	58,906,076.43

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及定期折算份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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

1、经国海富兰克林基金管理有限公司 2015 年股东会第八次会议审议通过，自 2016 年 1 月 4 日起，吴显玲女士不再担任公司董事长，由 Gregory E. McGowan 先生担任公司董事长。相关公告已于 2016 年 1 月 9 日在《中国证券报》和公司网站披露。

2、经国海富兰克林基金管理有限公司第四届董事会第二十二次会议审议通过，自 2016 年 1 月 7 日起，吴显玲女士担任公司总经理，全面主持经营管理工作。相关公告已于 2016 年 1 月 9 日在《中国证券报》和公司网站披露。

3、经国海富兰克林基金管理有限公司第四届董事会第二十六次会议审议通过，自 2016 年 12 月 7 日起，王雷先生担任公司副总经理。相关公告已于 2016 年 12 月 9 日在《中国证券报》和公司网站披露。

4、经公司决定，同意增聘鲍翔先生为富兰克林国海中证 100 指数增强型分级证券投资基金的基金经理，与现任基金经理张志强先生共同管理该基金。公司已办理完成上述基金经理的变更手续。详情请参阅 2016 年 5 月 5 日相关公告。

#### (二) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2016 年 12 月，郭德秋先生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。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内未发生基金投资策略的改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人应支付给会计师事务所的审计费用是人民币 60000.00 元，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。

## 11.6 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等情况。

(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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	2	100,733,297.50	40.17%	93,297.22	40.19%	-
光大证券	2	79,028,229.25	31.51%	73,425.50	31.63%	-
海通证券	2	32,819,379.88	13.09%	30,305.83	13.06%	-
招商证券	1	17,945,541.17	7.16%	16,353.91	7.05%	-
国信证券	1	10,187,762.55	4.06%	9,487.92	4.09%	-
广发证券	1	3,937,111.01	1.57%	3,587.82	1.55%	-
东方证券	2	3,697,360.98	1.47%	3,443.14	1.48%	-
华创证券	1	2,429,463.00	0.97%	2,213.98	0.95%	-
中银国际	1	12,173.00	0.00%	11.10	0.00%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

民生证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

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：

- ① 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- ② 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；
- ③ 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；
- ④ 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；
- ⑤ 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) 公司基金交易佣金分配依据券商提供的研究报告和服务质量，评判标准包括但不限于：

- ① 全面及时向公司提供高质量的关于宏观、行业和市场的研究报告；
- ② 具有数量研究和开发能力；
- ③ 能有效组织上市公司调研；
- ④ 能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；
- ⑤ 上门路演和电话会议的质量；
- ⑥ 与我公司投资和研究人员的交流沟通和沟通能力；
- ⑦ 其他与投资相关的服务和支持。

#### 3) 租用基金专用交易单元的程序

① 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。

② 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。

③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变更情况

报告期内，本基金新增光大证券深圳交易单元 1 个，东吴证券深圳交易单元 1 个，东吴证券上海交易单元 1 个。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	46,838.40	100.00%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

国海富兰克林基金管理有限公司

2017 年 3 月 28 日