富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金2010年年度报告摘要

2010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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年三月二十六日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年3月18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,应阅读年度报告全文。

本报告中的财务资料经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告,基金管理人在年度报告正文中对相关事项有详细说明,请投资者注意阅读。

本报告期自2010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	国富沪深300指数增强
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3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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,151,469,617.89份
基金合同存续期	不定期

2.2 指数产品说明

投资目标	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权成的偏差,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,本基金对业绩比较基准的年跟踪误差不超过8%。
投资策略	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化被动投资的基础上,基金管理人在债券(包括为主入股票、现金等各类资产之间仅进行适度的主动配置。通过运用深入的基本面分析及先进的数量技术,控制与标指数的跟踪误差,追求适度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,本基金所跟踪的目标指数为沪深300指数。 本产品在指数化投资的基础上辅以有限度的增强操作(化风险)及一般市场股票投资。具体而言,基金将基本依照目标指数的成份股构成权重,并借助数量化投资分析技术构造和调整指数化投资组合,在投资组合建立后,基金管理人在指数权重比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,使指数化组合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,本基金对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股票市值集与一般市场股票投资,以在不增加额外风险的前提下提高收益水平,争取获得超过指数的回报。 债券投资策略: 本基金将在对宏观经济和货币市场进行研究的基础上,对利率结构、市场利率走势进行分析和预测,综合考虑中国债券指数各成份券种及金融债的收益水平、流动性的好坏等因素,进行优化选择构建本基金的债券投资组合。 本基金以富兰克林基金管理有限公司投资决策委员会为投资决策机构,以中长期利率趋势分析为主,结合经济周期、宏观经济运行中的价格指数、资金供求分析、货币政策、财政政策研究及收益率曲线分析,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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡伦耀	李芳菲
	联系电话	021-3855 5555	010-6320 1510
	电子邮箱	service@ftfdfund.com	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		021-38789555、400-700-4518和9510-5680	95599
传真		021-6888 0981	010-6320 1816

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.ftfdfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海浦东路202号普华永道中心11楼

§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	2010年	2009年9月3日(基金合同生效日)至2009年12月31日
本期已实现收益	98,329,193.11	133,932,805.55
本期利润	-105,398,451.96	370,162,771.34
加权平均基金份额本期利润	-0.0682	0.1636
本期基金份额净值增长率	-5.89%	15.50%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	0.087	0.063
期末基金资产净值	1,251,081,095.65	2,039,900,498.04
期末基金份额净值	1.087	1.155

注:1.本基金合同生效日为2009年9月3日,基金合同生效日与其成立日一致;2.上述财务指标采用的计算公式,请见运算公式在的证券投资基金信息披露格式规则—第1号《证券投资基金信息披露格式规则—第1号《证券投资基金信息披露格式规则—第1号《