

富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金

2012 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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年三月二十七日

5.1 重要提示

基金管理人承诺:基金管理人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2013年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况等,未发现虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

5.2 基金简介

2.1 基金基本情况
基金名称:富兰克林国海300指数增强型证券投资基金
基金代码:480008
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

2.2 基金产品说明
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
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

2.3 基金管理人、基金托管人
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

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 本期主要指标
3.1.2 基金净值表现

Table with 4 columns: 项目, 2012年, 2011年, 2010年. Rows include 本期投资收益, 本期基金份额净值, 基金份额净值增长率, etc.

注:1. 上述财务指标的计算方式,详见证监会发布的证券投资基金信息披露编报规则第一号《主要财务指标的会计处理规定》。
2. 本期个别投资收益指标本期利息收入,投资其他,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的净额,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。



注:1. 本基金自基金合同生效日至2009年9月13日,本基金在两个建仓周期内,各项投资比例符合基金合同约定。
2. 根据本基金合同,本基金投资组合的范围为:股票资产占基金资产的比例不低于85%。投资于沪、深两市的股票成份股,备选成份股占基金资产的90%。

注:1. 本基金成立于2009年9月13日,截至2009年的业绩为成立以来的业绩中的一部分。
2. 根据基金合同,本基金投资组合的范围为:股票资产占基金资产的85%。
3. 过去三年基金的投资收益情况

4.1 基金管理人及基金托管人
4.1.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.1.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.2 基金管理人及基金托管人
4.2.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.2.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.3 基金管理人及基金托管人
4.3.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.3.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.4 基金管理人及基金托管人
4.4.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.4.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.5 基金管理人及基金托管人
4.5.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.5.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

2012年12月31日

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
4.6.1 估值程序
4.6.2 估值方法

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
4.7.1 利润分配政策
4.7.2 利润分配实施情况

4.8 基金管理人及基金托管人
4.8.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.8.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.9 基金管理人及基金托管人
4.9.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.9.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.10 基金管理人及基金托管人
4.10.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.10.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.11 基金管理人及基金托管人
4.11.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.11.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.12 基金管理人及基金托管人
4.12.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.12.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.13 基金管理人及基金托管人
4.13.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.13.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.14 基金管理人及基金托管人
4.14.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.14.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.15 基金管理人及基金托管人
4.15.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.15.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.16 基金管理人及基金托管人
4.16.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.16.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.17 基金管理人及基金托管人
4.17.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.17.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.18 基金管理人及基金托管人
4.18.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.18.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.19 基金管理人及基金托管人
4.19.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.19.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.20 基金管理人及基金托管人
4.20.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.20.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.21 基金管理人及基金托管人
4.21.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

2012年12月31日

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
4.6.1 估值程序
4.6.2 估值方法

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
4.7.1 利润分配政策
4.7.2 利润分配实施情况

4.8 基金管理人及基金托管人
4.8.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.8.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.9 基金管理人及基金托管人
4.9.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.9.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.10 基金管理人及基金托管人
4.10.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.10.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.11 基金管理人及基金托管人
4.11.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.11.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.12 基金管理人及基金托管人
4.12.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.12.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.13 基金管理人及基金托管人
4.13.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.13.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.14 基金管理人及基金托管人
4.14.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.14.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.15 基金管理人及基金托管人
4.15.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.15.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.16 基金管理人及基金托管人
4.16.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.16.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.17 基金管理人及基金托管人
4.17.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.17.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.18 基金管理人及基金托管人
4.18.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.18.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.19 基金管理人及基金托管人
4.19.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.19.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.20 基金管理人及基金托管人
4.20.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

4.20.2 基金托管人
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

4.21 基金管理人及基金托管人
4.21.1 基金管理人
国海富兰克林基金管理有限公司
基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司

Table with 5 columns: 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(%). Lists various stocks like 友邦保险, 民生证券, etc.

注:1. 上述股票买入成交金额(成交价款扣除佣金)数据,不考虑相关交易费用。
2. 买入股票成交金额(成交价款扣除佣金)数据,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 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(%). Lists various stocks like 友邦保险, 民生证券, etc.

注:1. 上述股票卖出成交金额(成交价款扣除佣金)数据,不考虑相关交易费用。
2. 卖出股票成交金额(成交价款扣除佣金)数据,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 期末持仓金额, 占基金资产净值比例(%). Lists various bonds like 国债, 企业债, etc.

注:1. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。
2. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 期末持仓金额, 占基金资产净值比例(%). Lists various bonds like 国债, 企业债, etc.

注:1. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。
2. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 期末持仓金额, 占基金资产净值比例(%). Lists various bonds like 国债, 企业债, etc.

注:1. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。
2. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 期末持仓金额, 占基金资产净值比例(%). Lists various bonds like 国债, 企业债, etc.

注:1. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。
2. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 期末持仓金额, 占基金资产净值比例(%). Lists various bonds like 国债, 企业债, etc.

注:1. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。
2. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 期末持仓金额, 占基金资产净值比例(%). Lists various bonds like 国债, 企业债, etc.

注:1. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。
2. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 期末持仓金额, 占基金资产净值比例(%). Lists various bonds like 国债, 企业债, etc.

注:1. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。
2. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 期末持仓金额, 占基金资产净值比例(%). Lists various bonds like 国债, 企业债, etc.

注:1. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。
2. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 期末持仓金额, 占基金资产净值比例(%). Lists various bonds like 国债, 企业债, etc.

注:1. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。
2. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 期末持仓金额, 占基金资产净值比例(%). Lists various bonds like 国债, 企业债, etc.

注:1. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。
2. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 期末持仓金额, 占基金资产净值比例(%). Lists various bonds like 国债, 企业债, etc.

注:1. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。
2. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 期末持仓金额, 占基金资产净值比例(%). Lists various bonds like 国债, 企业债, etc.

注:1. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。
2. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 期末持仓金额, 占基金资产净值比例(%). Lists various bonds like 国债, 企业债, etc.

注:1. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。
2. 上述债券持仓数据,不考虑相关交易费用。