

---

**富兰克林国海中国收益证券投资基金**  
**2012 年年度报告摘要**  
**2012 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一三年三月二十七日

## § 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 3 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 2012 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	国富中国收益混合
基金主代码	450001
交易代码	450001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 6 月 1 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	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,428,840,035.64 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以富兰克林邓普顿投资集团环球资产管理平台为依托，在充分结合国内新兴证券市场特性的原则下，通过投资稳健分红的股票和各种优质的债券，达到基金资产稳健增长的目的，为投资者创造长期稳定的投资收益。
投资策略	资产配置量化策略： 一般情况下，投资决策委员会负责基金资产的配置策略，并采用资

	<p>产配置分析会的形式来实施，以资产配置分析会的组织形式保证资产配置决策的正确性和科学性。资产配置分析会由投资总监主持，基金经理和研究部总监参加。本基金通常以每个季度为一个调整周期，在资产配置分析会上，对拟定的投资组合调整方案进行检验。基金经理负责提交一份对未来一个季度投资组合建议的调整报告，供委员会讨论，形成最终结论，投资总监在投资决策委员会的授权下，根据市场变化情况拥有一定权限对投资组合进行灵活调整。</p> <p>股票选择策略：          为了能够恰当地运用富兰克林邓普顿投资集团的全球化标准，股票分析员必须对行业的整体趋势和该行业在中国的具体特点有一个深入而清楚的研究。之后，股票分析员以行业整体趋势为背景，寻找最契合所在行业发展趋势的公司，并着重评估公司管理层、公司战略、公司品质以及潜在的变化和风险等基本因素；通过综合最优评价系统对潜在的股票进行优化分析。</p> <p>债券投资策略：          本基金债券组合的回报来自于三个方面：组合的久期管理、识别收益率曲线中价值低估的部分以及识别各类债券中价值低估的种类（例如企业债存在信用升级的潜力）。</p>
业绩比较基准	40%×富时中国 A200 指数+ 55%×中国国债指数(全价)+5%×同业存款息率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中收益稳定、风险较低的品种。风险系数介于股票和债券之间。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	储丽莉	赵会军
	联系电话	021-3855 5555	010-66105799
	电子邮箱	service@ftsfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-700-4518、9510-5680和021-38789555	95588
传真		021-6888 3050	010-66105798

### 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	2012 年	2011 年	2010 年
本期已实现收益	-127,586,268.81	-11,078,505.55	206,186,874.12
本期利润	11,788,019.84	-210,815,255.92	64,046,359.29
加权平均基金份额本期利润	0.0079	-0.1195	0.0285
本期加权平均净值利润率	1.65%	-20.98%	4.47%
本期基金份额净值增长率	1.38%	-19.69%	5.00%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配利润	-138,890,375.73	-187,515,991.40	207,617,881.67
期末可供分配基金份额利润	-0.0972	-0.1038	0.1033
期末基金资产净值	691,593,922.57	862,380,234.69	1,375,566,630.88
期末基金份额净值	0.4840	0.4774	0.6846

注：1. 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》。

2. 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。

3. 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）。

4. 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	3.62%	0.81%	4.08%	0.51%	-0.46%	0.30%
过去六个月	2.43%	0.81%	0.62%	0.49%	1.81%	0.32%
过去一年	1.38%	0.89%	3.70%	0.49%	-2.32%	0.40%
过去三年	-14.51%	0.99%	-10.40%	0.55%	-4.11%	0.44%
过去五年	-23.40%	1.19%	-18.77%	0.78%	-4.63%	0.41%

自基金合同生效起至今	109.10%	1.12%	72.97%	0.76%	36.13%	0.36%
------------	---------	-------	--------	-------	--------	-------

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=40% × 富时中国 A200 指数+ 55% × 中国国债指数(全价)+5% × 同业存款息率。本基金股票投资部分的业绩比较基准采用富时中国 A200 指数，债券投资部分的业绩比较基准采用中债国债总指数（全价），两个指数均具有较强的代表性。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，日收益率（ $Benchmark_t$ ）按下列公式计算：

$$Benchmark_t = 40\% \times (\text{富时中国 A200 指数} / \text{富时中国 A200 指数}_{t-1}) + 55\% \times (\text{中债国债总指数(全价)} / \text{中债国债总指数(全价)}_{t-1}) + 5\% \times \text{同业存款利率} / 360$$

其中， $t=1,2,3,\dots,T$ ， $T$  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

富兰克林国海中国收益证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2005 年 6 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日)



注：1、本基金的基金合同生效日为 2005 年 6 月 1 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。

2、截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同的约定。基金合同中关于基金投资比例

的约定如下：

“股票投资为基金资产的 20%至 65%，债券为 35%至 75%，现金类资产为 5%至 20%。本基金的股票投资主要集中于具有良好分红记录的上市公司，该部分股票和债券投资比例将不低于本基金资产的 80%。”

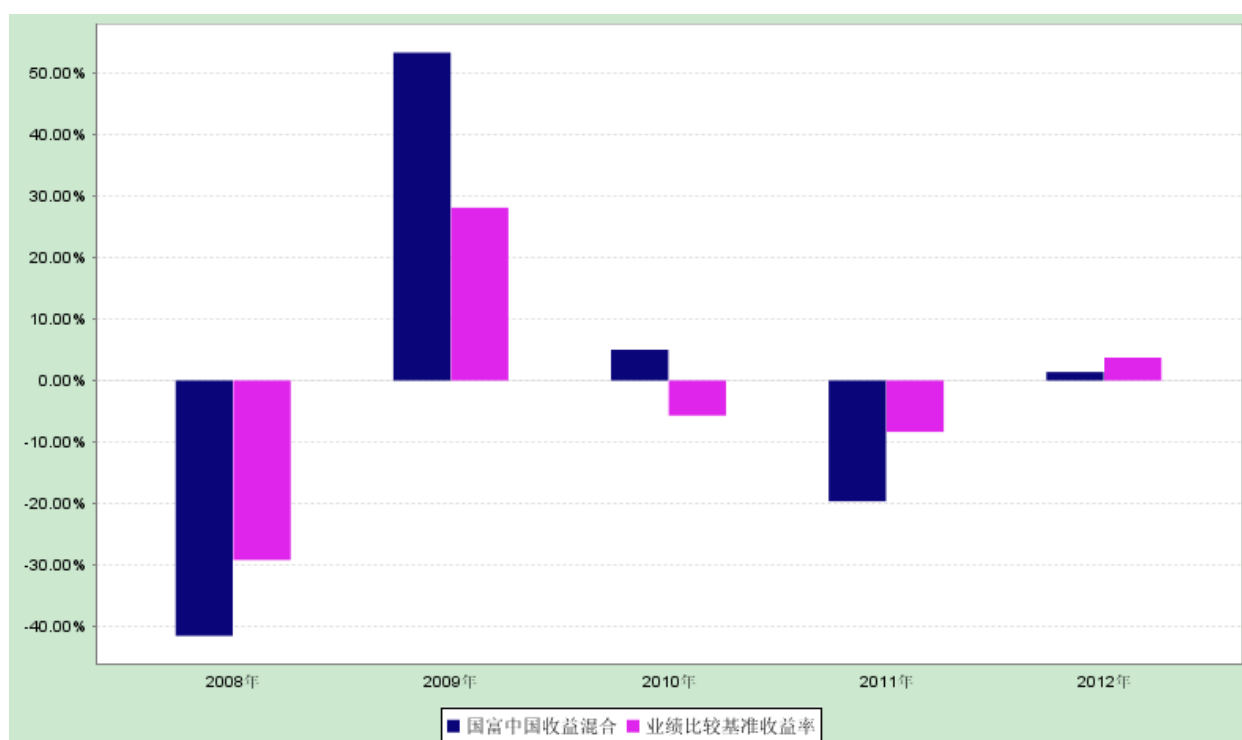
由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合上述约定比例的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的除外。

3、本基金本报告期遵守法律、法规和基金合同的比例限制进行证券投资。

### 3.2.3 过去五年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

富兰克林国海中国收益证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：1、根据基金合同，本基金的资产配置比例范围为：股票 20%—65%，债券 35%—75%，现金 5%—20%。

2、本基金的业绩比较基准 = 40% × 富时中国 A200 指数 + 55% × 中国国债指数(全价) + 5% × 同业存款息率。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012	0.000	0.00	0.00	0.00	-
2011	0.900	106,724,932.95	65,755,900.15	172,480,833.10	-
2010	1.700	293,449,331.09	128,556,195.21	422,005,526.30	-

合计	2.600	400,174,264.04	194,312,095.36	594,486,359.40	-
----	-------	----------------	----------------	----------------	---

## § 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。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 60 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，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。截至本报告期末，从 2005 年 6 月第一只基金成立到现在，本公司已经成功管理了 12 只基金产品（包含 A、C 类债券基金）。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
刘怡敏	本基金基金经理、富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金基金经理、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金基金经理	2010-03-27	-	9 年	刘怡敏女士，CFA，四川大学金融学硕士。曾任西南证券研究发展中心债券研究员，并曾在富国基金管理有限公司从事债券投资及研究工作。现任本基金基金经理、富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金基金经理，以及富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金基金经理。
徐荔蓉	本基金基金经理、富兰克林国海研究精选股票型证券投资基金的基金经理，并同时担任研究	2010-09-29	-	15 年	徐荔蓉先生，CFA，CPA（非执业），律师（非执业），中央财经大学经济学硕士，曾任职融通基金管理有限公司研究策划部副总监、通乾基金经理助理、通利债券基金经理，申万巴黎基金有限公司盛利精选基金经理，国海富兰克林基金管理有限公司研究

	分析部总经理和投资总监				分析部总经理和资产管理部总经理兼专户投资经理等职。现任本基金的基金经理、富兰克林国海研究精选股票型证券投资基金的基金经理，并同时担任国海富兰克林基金管理有限公司研究分析部总经理和投资总监。
--	-------------	--	--	--	--

注：1. “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。

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《富兰克林国海中国收益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，公司共管理了十二只公募基金及四只专户产品。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，报告期内不存在交易价差显著非零且对组合持仓市值贡献超过 1%的样本组合。

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。报告期内公司不存在投资组合之间发生的同日反向交易，其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的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年宏观经济经历了逐季探底的过程，投资者对宏观经济的预期也呈现逐步下调的特征。股票市场运行则颇为曲折，年初在对政策存在乐观预期和 2011 年大幅下跌后反弹需求的双重作用下，市场出现了 15%左右的上涨，成交也十分活跃。在 5 月后由于经济呈现逐步回落和乐观预期落空等多种因素的影响，市场持续下行并创出近三年的新低。对新一届政府领导人的乐观预期又导致市场在 12 月份出现了戏剧性的大幅反弹，最终全年上证指数上涨 3.17%，沪深 300 指数上涨 7.55%，而创业板指数下跌 2.14%。我们在年初对市场行情的判断趋于谨慎，因此投资组合更多配置在成长类公司，导致组合在上半年中落后指数较多，随着下半年市场逐步趋于过度悲观，我们提高了股票仓位，并保持投资组合的适度均衡，同时对部分股票进行了适度的波段操作，但全年仍然未能战胜业绩基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 2012 年基金净值增长率 1.38%，未能战胜业绩基准。主要的负面贡献来自于个股选择，部分持有的公司本年度表现大大落后于指数，导致组合在上半年大幅度落后指数，虽然下半年组合表现较好，但全年仍落后业绩基准。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们仍然对未来中国宏观经济的走势持较为乐观的态度，中国经济的转型必然是建立在相对较高的经济增长速度上的，未来经济预期将保持相对较高的经济增长速度，同时经济转型也将逐步进行。而中国的股票市场经过连续三年的持续调整，整体估值逐步趋于合理，目前蓝筹股的估值从横向和纵向的角度看仍有相当的优势，而中小市值的公司仍然将面临较大的估值压力。从流动性的角度看，未来整体宏观流动性将稳定下行，居民在股票市场的配置仍然非常低，未来居民资产配置的变化将是股票市场的主要驱动力。总体来看我们对 2013 年的股票市场持偏乐观的态度，未来的关注重点将仍然集中在被市场低估的成长股，我们将尽量保持组合在行业、风格上的相对均衡。

#### 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资产估值委员会（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，确保基金估值的公允、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。公司估值委员会由总经理（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。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

2012 年，本基金托管人在对富兰克林国海中国收益证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012 年，富兰克林国海中国收益证券投资基金的管理人——国海富兰克林基金管理有限公司在富兰克林国海中国收益证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，富兰克林国海中国收益证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对国海富兰克林基金管理有限公司编制和披露的富兰克林国海中国收益证券投资基金 2012 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：富兰克林国海中国收益证券投资基金

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日

<b>资产：</b>		
银行存款	24,937,533.44	7,865,426.17
结算备付金	596,916.99	1,403,702.65
存出保证金	750,000.00	848,780.49
交易性金融资产	674,823,218.00	844,577,828.82
其中：股票投资	428,251,446.70	539,854,246.76
基金投资	-	-
债券投资	246,571,771.30	304,723,582.06
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	4,230,632.71
应收利息	2,423,250.10	3,205,581.33
应收股利	-	-
应收申购款	15,433.90	5,824,939.94
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	703,546,352.43	867,956,892.11
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2012年12月31日</b>	<b>上年度末 2011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	7,117,205.90	-
应付赎回款	453,266.69	552,175.43
应付管理人报酬	771,804.82	1,024,761.56
应付托管费	139,819.73	185,645.21
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	323,543.64	461,628.56
应交税费	2,272,579.04	1,900,163.40
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	874,210.04	1,452,283.26
负债合计	11,952,429.86	5,576,657.42
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	830,484,298.30	1,049,896,226.09
未分配利润	-138,890,375.73	-187,515,991.40
所有者权益合计	691,593,922.57	862,380,234.69
负债和所有者权益总计	703,546,352.43	867,956,892.11

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.4840 元，基金份额总额 1,428,840,035.64 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富兰克林国海中国收益证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12 月31日
<b>一、收入</b>	<b>27,576,088.73</b>	<b>-187,127,981.76</b>
1. 利息收入	8,260,943.58	8,453,598.74
其中：存款利息收入	249,887.09	302,040.35
债券利息收入	7,959,830.09	8,150,020.86
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	51,226.40	1,537.53
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-120,129,722.47	3,543,514.38
其中：股票投资收益	-127,651,874.70	5,840,967.51
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,682,287.89	-6,478,111.13
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	4,839,864.34	4,180,658.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	139,374,288.65	-199,736,750.37
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	70,578.97	611,655.49
<b>减：二、费用</b>	<b>15,788,068.89</b>	<b>23,687,274.16</b>
1. 管理人报酬	9,887,058.87	13,887,620.19
2. 托管费	1,791,133.91	2,515,873.19
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,564,123.20	6,391,589.95
5. 利息支出	115,658.05	447,449.04
其中：卖出回购金融资产支出	115,658.05	447,449.04
6. 其他费用	430,094.86	444,741.79
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>11,788,019.84</b>	<b>-210,815,255.92</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>11,788,019.84</b>	<b>-210,815,255.92</b>

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海中国收益证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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）	1,049,896,226.09	-187,515,991.40	862,380,234.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,788,019.84	11,788,019.84
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）	-219,411,927.79	36,837,595.83	-182,574,331.96
其中：1. 基金申购款	13,717,953.04	-2,454,542.71	11,263,410.33
2. 基金赎回款	-233,129,880.83	39,292,138.54	-193,837,742.29
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）	830,484,298.30	-138,890,375.73	691,593,922.57
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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）	1,167,948,749.21	207,617,881.67	1,375,566,630.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-210,815,255.92	-210,815,255.92
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）	-118,052,523.12	-11,837,784.05	-129,890,307.17
其中：1. 基金申购款	309,159,513.44	23,712,939.06	332,872,452.50
2. 基金赎回款	-427,212,036.56	-35,550,723.11	-462,762,759.67
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）	-	-172,480,833.10	-172,480,833.10
五、期末所有者权益（基金净值）	1,049,896,226.09	-187,515,991.40	862,380,234.69

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：

基金管理公司负责人：李雄厚，主管会计工作负责人：董卫军，会计机构负责人：黄宇虹

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

富兰克林国海中国收益证券投资基金(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”)证监基金字[2005]第 36 号《关于同意富兰克林国海中国收益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《富兰克林国海中国收益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 671,504,027.15 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(2005)第 77 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《富兰克林国海中国收益证券投资基金基金合同》于 2005 年 6 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 671,658,080.51 份基金份额,其中认购资金利息折合 154,053.36 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《富兰克林国海中国收益证券投资基金招募说明书》和《富兰克林国海中国收益证券投资基金基金份额拆分比例公告》的有关规定,本基金于 2007 年 5 月 15 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 1.7204887030,并于 2007 年 5 月 16 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海中国收益证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行的股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的范围为:股票投资为基金资产的 20%-65%,债券为 35%-75%,现金类资产为 5%-20%。本基金的股票投资主要集中于具有良好分红记录的上市公司,该部分股票和债券投资比例将不低于本基金资产的 80%。本基金的原业绩比较基准为:40%×新华富时 A200 指数+55%×汇丰中国国债指数+5%×同业存款利率,根据本基金的基金管理人发布的《国海富兰克林基金管理有限公司关于旗下部分基金更改业绩比较基准和修改基金合同的公告》和《关于修改<富兰克林国海中国收益证券投资基金基金合同>的公告》,本基金的业绩比较基准自 2010 年 12 月 23 日起变更为 40%×富时中国 A200 指数+55%×中债国债总指数(全价)+5%×同业存款利率。

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 2013 年 03 月 20 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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》、《富兰克林国海中国收益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 2012 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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 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

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一致。

### 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 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[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[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》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。
- (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，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。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税。
- (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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
国海证券股份有限公司(“国海证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
邓普顿国际股份有限公司(Templeton International, Inc.)	基金管理人的股东

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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	256,047,272.05	11.13%	549,020,789.05	13.26%

###### 7.4.8.1.2 权证交易

无。

###### 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 2012年1月1日至2012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	221,904.86	11.27%	39,267.14	12.20%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	453,586.58	13.11%	180,654.98	39.25%

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 2012年1月1日至2012年12月31 日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,887,058.87	13,887,620.19
其中：支付销售机构的客户维护费	1,714,190.18	2,097,365.09

注：支付基金管理人国海富兰克林基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.38% 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：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.38% / 当年天数。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31 日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,791,133.91	2,515,873.19

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 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

单位：人民币元

本期 2012年1月1日至2012年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	10,126,130.14	-	-	-	-

#### 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自有资金投资本基金的情况

- 1.基金管理人运用自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.本报告期和上年度可比期间（2011年1月1日至2011年12月31日）基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 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（2011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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
中国工商银行	24,937,533.44	233,677.34	7,865,426.17	263,084.90

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

金额单位：人民币元

本期 2012年1月1日至2012年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日					

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国海证券	1180078	11 霍煤债 01	新债分销	100,000	10,000,000.00

注：1、本基金在本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

2、本基金在上年度可比期间向"11 霍煤债 01"主承销商华林证券认购了 1000 万元该公司债券，国海证券为该债券分销商之一。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 期末（2012 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

无。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 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

无。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 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) 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。

###### (b) 以公允价值计量的金融工具

## (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

## (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2012 年 12 月 31 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级的余额为 574,415,218.00 元，属于第二层级的余额为 100,408,000.00 元，无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日：第一层级 714,789,828.82 元，第二层级 129,788,000.00 元，无第三层级)。

## (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，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的公允价值列入第一层级；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，确定相关股票公允价值应属第二层级还是第三层级。

## (iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(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	428,251,446.70	60.87
	其中：股票	428,251,446.70	60.87
2	固定收益投资	246,571,771.30	35.05
	其中：债券	246,571,771.30	35.05
	资产支持证券	-	-

3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	25,534,450.43	3.63
6	其他各项资产	3,188,684.00	0.45
7	合计	703,546,352.43	100.00

## 8.2 期末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	采掘业	11,448,000.00	1.66
C	制造业	300,019,522.27	43.38
C0	食品、饮料	76,413,884.37	11.05
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	12,507,823.69	1.81
C4	石油、化学、塑胶、塑料	38,080,245.50	5.51
C5	电子	28,719,650.74	4.15
C6	金属、非金属	8,250,000.00	1.19
C7	机械、设备、仪表	99,731,574.77	14.42
C8	医药、生物制品	36,316,343.20	5.25
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	13,476,000.00	1.95
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	37,723,136.40	5.45
H	批发和零售贸易	14,400,000.00	2.08
I	金融、保险业	33,091,788.03	4.78
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	10,968,000.00	1.59
L	传播与文化产业	7,125,000.00	1.03
M	综合类	-	-
	合计	428,251,446.70	61.92

## 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

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	300124	汇川技术	2,069,184	49,556,956.80	7.17
2	002230	科大讯飞	1,244,988	37,723,136.40	5.45
3	600519	贵州茅台	149,810	31,313,286.20	4.53
4	002250	联化科技	1,296,269	25,277,245.50	3.65
5	000581	威孚高科	598,622	19,096,041.80	2.76
6	601318	中国平安	399,907	18,111,788.03	2.62
7	600276	恒瑞医药	600,000	18,060,000.00	2.61
8	000651	格力电器	600,000	15,300,000.00	2.21
9	601628	中国人寿	700,000	14,980,000.00	2.17
10	600559	老白干酒	387,283	14,325,598.17	2.07

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	600519	贵州茅台	53,314,047.98	6.18
2	300124	汇川技术	48,995,105.68	5.68
3	000063	中兴通讯	33,827,549.99	3.92
4	002073	软控股份	33,410,159.57	3.87
5	000651	格力电器	33,326,072.51	3.86
6	600036	招商银行	24,943,915.60	2.89
7	002250	联化科技	24,391,459.76	2.83
8	600016	民生银行	23,809,858.40	2.76
9	000848	承德露露	23,307,680.41	2.70
10	000858	五粮液	23,076,594.19	2.68
11	000800	一汽轿车	22,380,619.62	2.60
12	600547	山东黄金	22,239,380.38	2.58
13	601888	中国国旅	21,631,210.31	2.51
14	002405	四维图新	21,226,069.94	2.46
15	000895	双汇发展	20,829,769.75	2.42
16	000060	中金岭南	20,140,562.10	2.34
17	601668	中国建筑	19,659,650.00	2.28
18	600765	中航重机	19,467,596.30	2.26
19	002140	东华科技	19,213,065.05	2.23

20	600125	铁龙物流	18,942,026.99	2.20
21	002294	信立泰	18,787,075.74	2.18
22	600486	扬农化工	18,288,594.78	2.12
23	600467	好当家	17,538,092.55	2.03
24	002230	科大讯飞	17,492,149.72	2.03

注：买入金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 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	600582	天地科技	45,607,651.74	5.29
2	600970	中材国际	42,523,371.28	4.93
3	002024	苏宁电器	37,915,837.41	4.40
4	600312	平高电气	36,642,500.56	4.25
5	000063	中兴通讯	30,130,601.67	3.49
6	300090	盛运股份	29,244,262.36	3.39
7	002073	软控股份	28,252,406.73	3.28
8	601699	潞安环能	27,595,436.49	3.20
9	000858	五粮液	25,675,864.58	2.98
10	600016	民生银行	24,824,842.59	2.88
11	600875	东方电气	23,543,999.14	2.73
12	000651	格力电器	23,543,571.53	2.73
13	600036	招商银行	23,192,882.09	2.69
14	600348	阳泉煤业	21,918,339.00	2.54
15	002230	科大讯飞	21,273,120.65	2.47
16	600486	扬农化工	21,230,162.10	2.46
17	002291	星期六	20,965,806.44	2.43
18	600858	银座股份	20,128,131.93	2.33
19	600765	中航重机	19,922,320.35	2.31
20	601668	中国建筑	19,809,166.67	2.30
21	600688	S 上石化	19,382,755.82	2.25
22	002140	东华科技	19,355,333.22	2.24
23	600519	贵州茅台	18,995,018.07	2.20
24	002294	信立泰	18,840,669.98	2.18
25	600467	好当家	18,795,889.17	2.18
26	600266	北京城建	18,690,990.64	2.17
27	002405	四维图新	18,687,576.72	2.17
28	000060	中金岭南	18,534,782.28	2.15



29	600859	王府井	18,461,523.67	2.14
30	000848	承德露露	17,785,415.59	2.06

注：卖出金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	1,089,435,823.24
卖出股票的收入（成交）总额	1,211,430,459.15

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	39,948,000.00	5.78
3	金融债券	30,195,000.00	4.37
	其中：政策性金融债	30,195,000.00	4.37
4	企业债券	76,049,738.80	11.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	100,379,032.50	14.51
8	其他	-	-
9	合计	246,571,771.30	35.65

#### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	647,650	66,649,661.50	9.64
2	1001060	10 央行票据 60	400,000	39,948,000.00	5.78
3	110317	11 进出 17	300,000	30,195,000.00	4.37
4	113001	中行转债	223,460	21,530,371.00	3.11
5	1280412	12 渝出版债	200,000	20,074,000.00	2.90

**8.7 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**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 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**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.9 投资组合报告附注**

**8.9.1** 本基金本期投资的前十名证券中，无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。

**8.9.2** 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。

**8.9.3** 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	750,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,423,250.10
5	应收申购款	15,433.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,188,684.00

**8.9.4** 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	66,649,661.50	9.64
2	113001	中行转债	21,530,371.00	3.11
3	110013	国投转债	12,199,000.00	1.76

**8.9.5** 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 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

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
46,036	31,037.45	293,676,501.03	20.55%	1,135,163,534.61	79.45%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	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开放式基金	0.00	0%

注：1. 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有该只基金的基金份额。

2. 该只基金的基金经理未持有该只基金的基金份额。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2005年6月1日)基金份额总额	671,658,080.51
本报告期期初基金份额总额	1,806,321,063.90
本报告期基金总申购份额	23,601,535.14
减：本报告期基金总赎回份额	401,082,563.40
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,428,840,035.64

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本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**

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

**(二) 基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动**

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**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**

本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 88000.00 元，本基金自成立以来对其进行审计的均为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未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

**(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，本基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

**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	
东海证券	1	830,103,184.97	36.08%	721,305.52	36.62%	-
国金证券	2	482,103,007.57	20.95%	399,916.80	20.30%	-
国泰君安	1	442,838,410.05	19.25%	370,679.12	18.82%	-
国海证券	2	256,047,272.05	11.13%	221,904.86	11.27%	-
申银万国	1	204,825,473.02	8.90%	180,273.68	9.15%	-
海通证券	1	48,813,039.56	2.12%	43,448.66	2.21%	-
中金公司	1	21,868,452.90	0.95%	19,909.10	1.01%	-
广发证券	1	14,267,442.27	0.62%	12,127.17	0.62%	-
中信金通	1	-	-	-	-	-

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) 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租用与变更情况

报告期内，根据上述基金专用交易单元选择标准和程序，本基金逐步租用证券公司的交易单元合计 11 个：国海证券、国金证券各 2 个、中金公司、广发证券、申银万国证券、国泰君安证券、海通证券、中信金通证券和东海证券各 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		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
东海证券	66,247,720.30	22.30%	172,000,000.00	100.00%	-	-
国金证券	23,127,494.36	7.79%	-	-	-	-
国泰君安	7,634,766.41	2.57%	-	-	-	-
国海证券	142,378,339.15	47.93%	-	-	-	-
申银万国	54,089,823.59	18.21%	-	-	-	-
海通证券	3,571,336.34	1.20%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-

国海富兰克林基金管理有限公司

二〇一三年三月二十七日