

---

**富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金**  
**2013 年年度报告摘要**  
**2013 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

报告送出日期：二〇一四年三月三十一日

## § 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 2014 年 3 月 28 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 2013 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	国富中小盘股票
基金主代码	450009
交易代码	450009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 11 月 23 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	1,249,643,815.58 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票，力求在有效控制风险的前提下，获得基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>大类资产配置：</p> <p>本基金通过分析宏观经济状况、资产估值水平和市场特征等因素，仅在上述资产配置范围内适度调整股票、债券、货币市场工具和其他法律法规允许的金融工具的投资比例。</p> <p>股票选择策略：</p> <p>本基金在资产配置范围相对固定的情况下，主要采用精选个股和行业优化的投资策略，挖掘并投资于具有良好治理结构、成长性好、估值合理及具有巨大发展潜力的中小市值上市公司。本基金的股票投资策略主要包括市值筛选策略、精选个股策略和行业优化策略。</p> <p>债券投资策略：</p> <p>本基金的债券投资为股票投资不易实施预定投资策略时的防守性措施。债券投资策略主要包括利率预期策略、久期管理策略、类属资产配置策略、个券选择策略等。</p>
业绩比较基准	中证 700 指数收益率×90%+银行同业存款利率×10%
风险收益特征	本基金是股票型基金，属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

### 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	唐州徽
	联系电话	021-3855 5555	95566
	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	010-66594942	

## 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	2013 年	2012 年	2011 年
本期已实现收益	270,273,725.96	-48,112,615.25	29,443,863.80
本期利润	-162,263,507.92	364,410,871.25	-322,341,987.39
加权平均基金份额本期利润	-0.0893	0.2153	-0.1577
本期加权平均净值利润率	-8.59%	23.45%	-16.18%
本期基金份额净值增长率	-8.18%	24.97%	-18.19%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配利润	-44,254,143.37	-62,266,309.32	-272,575,044.27
期末可供分配基金份额利润	-0.0354	-0.0351	-0.1590
期末基金资产净值	1,205,389,672.21	1,862,516,079.07	1,441,889,083.35
期末基金份额净值	0.965	1.051	0.841

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一第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	-2.13%	1.21%	-1.39%	1.20%	-0.74%	0.01%
过去六个月	-3.79%	1.21%	13.13%	1.22%	-16.92%	-0.01%
过去一年	-8.18%	1.23%	9.35%	1.27%	-17.53%	-0.04%
过去三年	-6.13%	1.23%	-22.66%	1.31%	16.53%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-3.50%	1.23%	-24.63%	1.31%	21.13%	-0.08%

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 = 中证 700 指数 × 90% + 同业存款利率 × 10%。本基金股票投资部分的业绩比较基准采用中证 700 指数，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，1 日收益率（ $Benchmark_t$ ）按下列公式计算：

$$Benchmark_t = 90\% \times (\text{中证 700 指数}_t / \text{中证 700 指数}_{t-1} - 1) + 10\% \times \text{同业存款利率} / 360$$

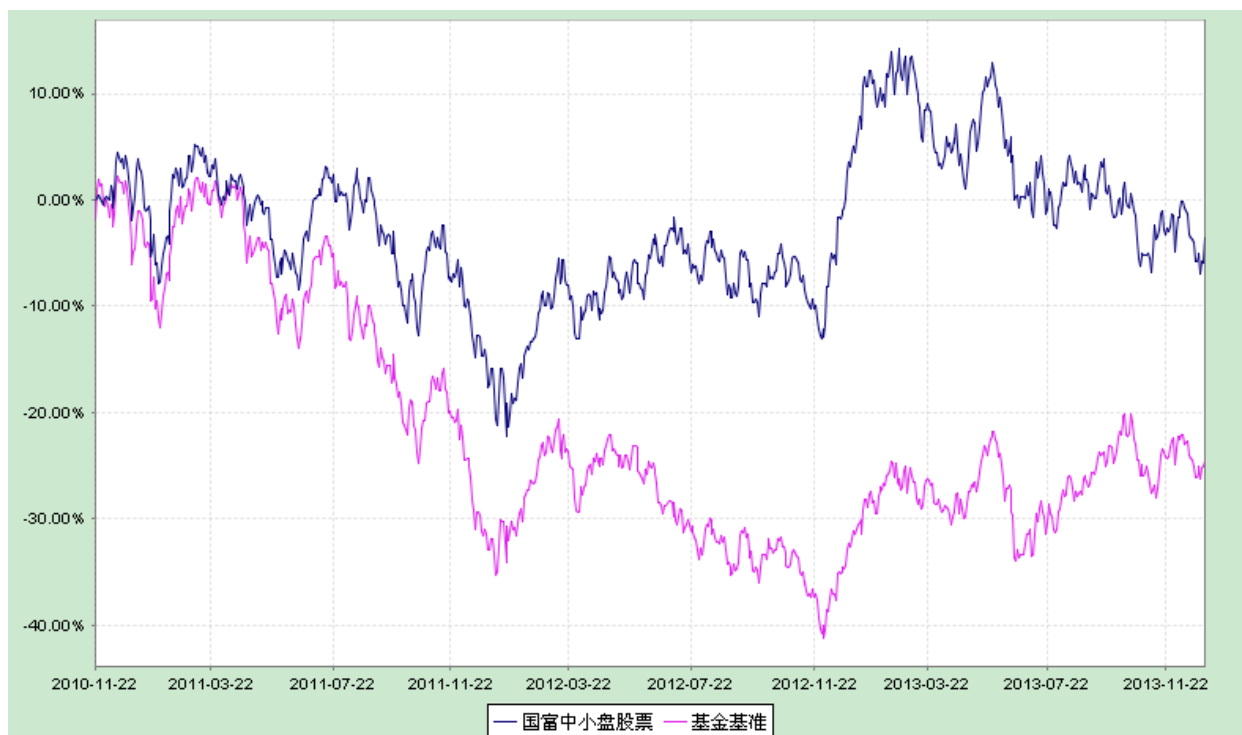
其中， $t=1,2,3,\dots,T$ ， $T$  表示时间截止日。

#### 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

富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金

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

（2010 年 11 月 23 日至 2013 年 12 月 31 日）



注：本基金的基金合同生效日为 2010 年 11 月 23 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

富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金

合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：本基金成立于 2010 年 11 月 23 日，故 2010 年的业绩为成立日至年底的业绩而非全年的业绩。

### 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
2013	0.000	0.00	0.00	0.00	-
2012	0.000	0.00	0.00	0.00	-
2011	0.000	0.00	0.00	0.00	-
合计	0.000	0.00	0.00	0.00	-

## §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，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。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 15 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		
赵晓东	国富沪深 300 指数增强基金，国	2010-11-23	-	10 年	赵晓东先生，香港大学 MBA。历任淄博矿业集团项目经理，浙江证券分析员，上海交大高新技术股份有限公司高级投资经理，国海证券有限责任公司行业研究

	富中小盘股票基金和国富焦点驱动混合基金的基金经理			员，国海富兰克林基金管理有限公司研究员、高级研究员、国富弹性市值股票基金和国富潜力组合股票基金的基金经理助理。现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、国富中小盘股票基金和国富焦点驱动混合基金的基金经理。
--	--------------------------	--	--	---

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《富兰克林国海中小盘股票型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，公司共管理了十五只公募基金及三只专户产品。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

2013 年，国内的证券市场呈现冰火两重的走势，创业板和中小板一路高歌，沪深 300 指数与大盘股久跌不止，这种差异化走势的背后是市场对经济转型成功的期望和对成长的强烈需求；本基金全年业绩基准中证 700 指数上涨 11%。从宏观经济来看，全年经济增长保持相对平稳，传统企业盈利持续恶化，投资和消费数据增速都出现了小幅下滑。2013 年经济增长的核心动力还是房地产和汽车等传统行业，虽然新兴产业增速很高，但由于基数小和规模小，对经济的拉动贡献不大。对经济影响比较大的负面因素是持续走高的市场利率，理财和互联网金融的快速普及，使得资金的转移更加迅速，对市

场的利率更加敏感；高利率对债务增加者带来了更大的负担；在这种宏观背景下，投资者追逐具有想象力的创业板和中小板，期待互联网经济的增长，传媒，互联网概念和信息技术等行业成为 2013 年的投资主题。

投资策略上，重点通过行业选择和个股选择来提高超额收益，但是由于本基金在 2013 年行业配置上偏重于趋于低估值的传统行业，导致风格上与市场出现较大偏差，特别是超配的白酒行业大幅落后市场，导致基金业绩大幅落后市场。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.965 元，本报告期份额净值下跌 8.18%，同期业绩基准上涨 9.35%，落后业绩基准 17.53%。本基金行业配置较多的白酒股和蓝筹股，是跑输市场的主要原因。

#### 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 2014 年上半年，中国的经济增长的动力在减弱，特别是前期增长核心的房地产，地方基建和汽车在经过快速增长和受制于高利率的影响，增速下滑是大概率事件。而持续的反腐也会压制消费的增速；人民币对大多数货币的持续升值和中国劳动力成本的持续上升，中国的出口优势在减弱。虽然十八届三中全会带来的改革会惠及到经济，如果户籍改革，土地改革，收入分配等制度改革能够顺利进行和实施，中国的潜在消费将会进一步释放，但是短期对经济的推动作用有限。2014 年美国和经济恢复可能出现波折，特别是美国宽松货币政策的退出，对经济和资本市场的负面影响都不可忽视。预计 2014 年的货币政策仍是稳健偏紧为主，财政政策以积极为主且偏民生，通货膨胀率预计 2% 到 3% 之间。资本市场经过 2013 年的剧烈变化，蓝筹股票的估值不高，市场存在较好的投资机会，而创业板和中小板的估值溢价存在回落的可能，风险不容忽视。本基金将继续重点关注深度价值的成长股和业绩可视性较好的成长股等公司。我们将积极寻找政策变化给市场带来的机会，精心选股，适配行业，争取获得超额贡献。

本基金将继续按照基金合同及相关法律法规要求，努力做好基金投资工作，争取未来更好的长期投资收益。

#### 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。公司估值委员会由董事长(本报告期内代为履行总经理职责)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小盘股票型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中，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、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：富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
<b>资 产：</b>		
银行存款	56,173,385.27	210,476,599.10
结算备付金	613,832.01	1,786,856.97
存出保证金	695,792.12	90,273.20
交易性金融资产	1,069,189,496.15	1,688,049,612.49
其中：股票投资	1,046,643,851.15	1,647,911,612.49
基金投资	-	-
债券投资	22,545,645.00	40,138,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	82,260,475.89	-
应收证券清算款	-	3,854,497.77
应收利息	626,095.42	477,472.34
应收股利	-	-
应收申购款	164,709.18	6,395,524.17
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,209,723,786.04	1,911,130,836.04
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2013年12月31日</b>	<b>上年度末 2012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	14,233.69	-
应付赎回款	1,324,020.04	44,600,148.97

应付管理人报酬	1,625,090.90	2,180,540.30
应付托管费	270,848.49	363,423.40
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	746,115.19	1,231,580.59
应交税费	52,268.00	52,268.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	301,537.52	186,795.71
负债合计	4,334,113.83	48,614,756.97
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,249,643,815.58	1,772,666,412.62
未分配利润	-44,254,143.37	89,849,666.45
所有者权益合计	1,205,389,672.21	1,862,516,079.07
负债和所有者权益总计	1,209,723,786.04	1,911,130,836.04

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.965 元，基金份额总额 1,249,643,815.58 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年12 月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12 月31日
<b>一、收入</b>	<b>-118,620,066.19</b>	<b>400,369,933.72</b>
1. 利息收入	3,248,759.84	3,035,922.76
其中：存款利息收入	1,359,177.03	815,117.12
债券利息收入	182,622.75	2,089,292.71
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,706,960.06	131,512.93
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	308,324,251.69	-15,500,615.66
其中：股票投资收益	260,052,758.33	-31,210,852.93
基金投资收益	-	-
债券投资收益	206,201.93	667,322.80
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	48,065,291.43	15,042,914.47
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-432,537,233.88	412,523,486.50

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,344,156.16	311,140.12
<b>减：二、费用</b>	<b>43,643,441.73</b>	<b>35,959,062.47</b>
1. 管理人报酬	28,462,206.25	23,262,237.92
2. 托管费	4,743,701.08	3,877,039.63
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	9,958,716.34	8,386,685.77
5. 利息支出	-	5,037.31
其中：卖出回购金融资产支出	-	5,037.31
6. 其他费用	478,818.06	428,061.84
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-162,263,507.92</b>	<b>364,410,871.25</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-162,263,507.92</b>	<b>364,410,871.25</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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）	1,772,666,412.62	89,849,666.45	1,862,516,079.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-162,263,507.92	-162,263,507.92
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）	-523,022,597.04	28,159,698.10	-494,862,898.94
其中：1. 基金申购款	1,957,044,082.12	157,439,336.75	2,114,483,418.87
2. 基金赎回款	-2,480,066,679.16	-129,279,638.65	-2,609,346,317.81
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）	1,249,643,815.58	-44,254,143.37	1,205,389,672.21
项目	上年度可比期间 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）	1,714,464,127.62	-272,575,044.27	1,441,889,083.35

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	364,410,871.25	364,410,871.25
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）	58,202,285.00	-1,986,160.53	56,216,124.47
其中：1. 基金申购款	576,436,892.23	-28,692,585.78	547,744,306.45
2. 基金赎回款	-518,234,607.23	26,706,425.25	-491,528,181.98
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）	1,772,666,412.62	89,849,666.45	1,862,516,079.07

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：吴显玲（董事长，本报告期内代为履行总经理职责），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

富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金(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[2010]第 1355 号《关于核准富兰克林国海中小盘股票型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《富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,050,679,870.87 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(2010)第 330 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 11 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,051,528,559.48 份。本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 848,688.61 元。在本基金成立后，其中 848,688.61 元折算为 848,688.61 份基金份额，划入基金份额持有人账户。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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资具有良好流动性的金融工具，投资范围包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、央行票据、可转换债券、权证及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具。在正常市场情况下，本基金将保持较高股票投资比例，不做大幅度的资产配置调整。其中，股票投资

的比例范围为基金资产的 80%-95%；债券、权证、货币市场工具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范围为 5%-20%。现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。本基金的业绩比较基准为：中证 700 指数收益率×90%+银行同业存款利率×10%。

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 2014 年 3 月 26 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》、《富兰克林国海中小盘股票型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 2013 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 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 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[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》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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。



(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，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。自 2013 年 1 月 1 日起，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。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、注册登记机构、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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	53,472,676.41	0.83%	1,012,438,832.99	18.37%

##### 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 2013年1月1日至2013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	47,318.37	0.82%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 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	849,645.75	18.03%	190,269.47	15.45%

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。权证交易不计佣金。

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 2013年1月1日至2013年12月31 日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	28,462,206.25	23,262,237.92
其中：支付销售机构的客户维护费	6,021,269.44	6,823,947.37

注：支付基金管理人 国海富兰克林基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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 1.50% / 当年天数。

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31 日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31 日
----	---------------------------------	--------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	4,743,701.08	3,877,039.63
----------------	--------------	--------------

注：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 0.25% 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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 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

无。

#### 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	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	51,987,071.57	51,987,071.57
期间申购/买入总份额	0.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额	51,987,071.57	51,987,071.57
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.16%	2.93%

注：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。

##### 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（2012 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	
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		2012 年 1 月 1 日至 2012 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	56,173,385.27	1,256,510.67	210,476,599.10	765,675.77

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

无。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.9 期末（2013 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**

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
002099	海翔药业	2013-10-16	重大资产重组	6.42	-	-	10,847,808	68,260,828.76	69,642,927.36	-

注：本基金截至 2013 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**

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 2013 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 999,546,568.79 元, 属于第二层级的余额为 69,642,927.36 元, 无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日: 第一层级 1,644,216,001.01 元, 第二层级 43,833,611.48 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	1,046,643,851.15	86.52
	其中: 股票	1,046,643,851.15	86.52
2	固定收益投资	22,545,645.00	1.86
	其中: 债券	22,545,645.00	1.86
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	82,260,475.89	6.80
	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	56,787,217.28	4.69
6	其他各项资产	1,486,596.72	0.12
7	合计	1,209,723,786.04	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	48,150.00	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	938,780,118.16	77.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,592,593.28	0.55
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	20,559,290.68	1.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	64,603,699.03	5.36
K	房地产业	16,060,000.00	1.33
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	-	-
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	1,046,643,851.15	86.83

## 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	000568	泸州老窖	5,239,796	105,529,491.44	8.75
2	002304	洋河股份	2,428,386	99,126,716.52	8.22
3	000858	五粮液	5,235,292	81,984,672.72	6.80
4	002099	海翔药业	10,847,808	69,642,927.36	5.78
5	600809	山西汾酒	3,525,690	68,045,817.00	5.65
6	600559	老白干酒	2,226,471	57,821,451.87	4.80
7	002037	久联发展	4,436,978	44,591,628.90	3.70
8	600267	海正药业	2,889,141	42,817,069.62	3.55
9	300257	开山股份	1,099,981	42,360,268.31	3.51

10	601318	中国平安	999,883	41,725,117.59	3.46
----	--------	------	---------	---------------	------

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	600809	山西汾酒	208,649,812.50	11.20
2	000568	泸州老窖	198,380,173.86	10.65
3	000858	五粮液	181,124,406.95	9.72
4	600519	贵州茅台	153,932,730.87	8.26
5	002304	洋河股份	112,439,697.71	6.04
6	000002	万科A	103,385,110.60	5.55
7	600559	老白干酒	100,698,289.26	5.41
8	000024	招商地产	98,537,621.46	5.29
9	600048	保利地产	86,552,639.77	4.65
10	000651	格力电器	85,858,336.64	4.61
11	600309	万华化学	82,686,633.01	4.44
12	600104	上汽集团	78,822,877.55	4.23
13	600267	海正药业	72,818,551.95	3.91
14	600089	特变电工	64,403,325.70	3.46
15	002037	久联发展	57,112,450.62	3.07
16	000157	中联重科	57,024,763.85	3.06
17	600970	中材国际	56,638,025.30	3.04
18	300257	开山股份	51,195,874.13	2.75
19	600702	沱牌舍得	51,105,458.90	2.74
20	601318	中国平安	50,783,586.43	2.73
21	600600	青岛啤酒	48,372,946.42	2.60
22	000630	铜陵有色	47,841,908.64	2.57
23	600199	金种子酒	46,880,655.45	2.52
24	600197	伊力特	46,618,097.45	2.50
25	600887	伊利股份	41,388,512.80	2.22
26	600900	长江电力	37,994,394.83	2.04

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	601166	兴业银行	159,245,158.77	8.55
2	002353	杰瑞股份	157,436,218.56	8.45
3	600016	民生银行	145,040,302.40	7.79
4	600000	浦发银行	141,615,676.55	7.60
5	000024	招商地产	102,907,798.91	5.53
6	002250	联化科技	99,356,597.30	5.33
7	600519	贵州茅台	98,827,148.87	5.31
8	600778	友好集团	97,976,711.17	5.26
9	300070	碧水源	94,985,473.81	5.10
10	300124	汇川技术	92,057,492.24	4.94
11	002422	科伦药业	86,236,361.27	4.63
12	000651	格力电器	79,269,255.41	4.26
13	000002	万科A	78,052,208.88	4.19
14	600048	保利地产	72,906,689.95	3.91
15	600498	烽火通信	70,252,810.96	3.77
16	600309	万华化学	66,240,809.88	3.56
17	300090	盛运股份	66,208,926.95	3.55
18	600089	特变电工	64,280,413.26	3.45
19	600637	百视通	58,565,389.88	3.14
20	002325	洪涛股份	56,418,609.05	3.03
21	000157	中联重科	56,386,652.60	3.03
22	601998	中信银行	54,050,583.74	2.90
23	600887	伊利股份	49,940,767.81	2.68
24	600837	海通证券	49,238,335.07	2.64
25	600559	老白干酒	47,972,679.52	2.58
26	600104	上汽集团	47,186,426.09	2.53
27	002663	普邦园林	43,019,045.45	2.31
28	000528	柳工	41,688,117.24	2.24
29	000501	鄂武商A	41,531,506.56	2.23
30	000858	五粮液	41,131,202.63	2.21
31	300303	聚飞光电	38,985,827.18	2.09
32	000731	四川美丰	38,780,584.93	2.08
33	600702	沱牌舍得	38,153,913.85	2.05

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



买入股票的成本（成交）总额	3,005,864,004.67
卖出股票的收入（成交）总额	3,435,118,552.19

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（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	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	18,468,000.00	1.53
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,077,645.00	0.34
8	其他	-	-
9	合计	22,545,645.00	1.87

#### 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

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	122088	11 综艺债	200,000	18,468,000.00	1.53
2	113005	平安转债	38,020	4,077,645.00	0.34

#### 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 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。

### 8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同，本基金不投资股指期货。

### 8.10 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。

### 8.11 投资组合报告附注

**8.11.1 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，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、处罚的情况说明如下：**

中国平安保险（集团）股份有限公司控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）于 2013 年 9 月 24 日收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（【2013】48 号），对平安证券在推荐万福生科 IPO 过程中，未能勤勉尽责地履行法定职责、出具的保荐书存在虚假记载给予处罚，责令平安证券改正违法行为，给予警告，没收业务收入 2,555 万元，并处以 5,110 万元罚款，暂停保荐业务许可 3 个月。中国平安保险（集团）股份有限公司表示，作为平安证券的控股股东，将积极督促平安证券严格按照中国证监会的要求缴纳罚没款，持续进行整改，切实保护投资者利益。

本基金对中国平安投资决策说明：本公司的投研团队经过充分研究认为该事件的负面影响在前期的股价表现中已反映完毕，我们买入中国平安主要是看好其保险业务领域的竞争力和集团综合化金融平台未来的业务拓展空间，平安证券此次事件不影响中国平安的长期价值。

**8.11.2 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。**

#### 8.11.3 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	695,792.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	626,095.42
5	应收申购款	164,709.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	1,486,596.72

**8.11.4 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。

**8.11.5 期末前十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	002099	海翔药业	69,642,927.36	5.78	资产重组

**§ 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
19,523	64,008.80	359,960,377.98	28.81%	889,683,437.60	71.19%

**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	725,835.92	0.058083%

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(2010年11月23日)基金份额总额	3,051,528,559.48
本报告期期初基金份额总额	1,772,666,412.62
本报告期基金总申购份额	1,957,044,082.12

减：本报告期基金总赎回份额	2,480,066,679.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,249,643,815.58

## § 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

1、经国海富兰克林基金管理有限公司第三届董事会第十八次会议审议通过，任命张晓东先生担任公司副总经理，相关公告已于 2013 年 6 月 8 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站披露；

2、经国海富兰克林基金管理有限公司第三届董事会第十八次会议审议通过，任命徐荔蓉先生担任公司副总经理，相关公告已于 2013 年 5 月 18 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站披露；

3、经国海富兰克林基金管理有限公司第三届董事会第十八次会议审议通过，任命李彪先生担任公司副总经理，相关公告已于 2013 年 7 月 12 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站披露；

4、经国海富兰克林基金管理有限公司第三届董事会第十八次会议审议通过，任命储丽莉女士担任公司督察长，原督察长李彪先生因工作需要，不再担任公司督察长，相关公告已于 2013 年 7 月 12 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站披露；

5、经国海富兰克林基金管理有限公司第三届董事会第二十二次会议审议通过，李雄厚先生不再担任公司总经理职务，在新任总经理正式就任前，由董事长吴显玲女士代为履行总经理职责，相关公告已于 2013 年 9 月 10 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站披露。

#### (二) 基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

2013 年 3 月 17 日中国银行股份有限公司公告，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。

2013 年 6 月 1 日中国银行股份有限公司公告，自 2013 年 5 月 31 日起，田国立先生就任本行董事

长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

### 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 100000.00 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没有受到稽查或处罚。

#### （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，基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚。

### 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	
民生证券	1	902,679,948.47	14.01%	821,798.20	14.19%	-
中银国际	1	873,354,704.25	13.56%	772,832.07	13.35%	-
长江证券	1	633,784,656.08	9.84%	576,994.22	9.96%	-
广发证券	1	554,544,946.74	8.61%	504,858.29	8.72%	-
申银万国	2	540,483,909.64	8.39%	478,603.33	8.26%	-

东方证券	2	441,512,208.55	6.85%	390,694.34	6.75%	-
兴业证券	1	405,143,565.81	6.29%	358,513.16	6.19%	-
招商证券	1	386,827,328.93	6.01%	342,304.52	5.91%	-
东海证券	1	336,435,415.53	5.22%	306,291.11	5.29%	-
光大证券	1	302,374,860.60	4.69%	275,280.35	4.75%	-
齐鲁证券	1	298,195,929.91	4.63%	271,479.68	4.69%	-
瑞银证券	1	287,419,777.21	4.46%	261,666.71	4.52%	-
海通证券	1	202,768,733.04	3.15%	184,600.82	3.19%	-
中金公司	2	177,259,473.96	2.75%	156,856.97	2.71%	-
国海证券	2	53,472,676.41	0.83%	47,318.37	0.82%	-
国信证券	1	44,724,421.73	0.69%	40,716.33	0.70%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	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
- 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 25 个：其中国海证券、中金公司、申银万国证券、中信建投证券和东方证券各 2 个，光大证券、长江证券、中信证券、海通证券、银河证券、中银国际证券、齐鲁证券、招商证券、华泰证券、国信证券、瑞银证券、广发证券、东海证券、兴业证券和民生证券各 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
民生证券	4,622,511.93	24.23%	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	585,000,000.00	51.86%	-	-
广发证券	-	-	308,000,000.00	27.30%	-	-
申银万国	-	-	5,000,000.00	0.44%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	14,451,711.50	75.77%	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	200,000,000.00	17.73%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	30,000,000.00	2.66%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

国海富兰克林基金管理有限公司

二〇一四年三月三十一日