

富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金

[2012]第三季度报告

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:二〇一二年十月二十五日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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、完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据法律法规的有关规定，于2012年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等，保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年7月1日起至2012年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国海中小盘股票

基金主代码 450009

交易代码 450009

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2010年11月23日

报告期末基金份额总额 1,747,888,544.53份

投资目标 本基金的投资目标是追求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。

大类资产配置： 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，以期在上述资产配置范围内调整股票、债券、货币市场工具和其他法律形式规定的金融工具的投资比例。

股票投资策略： 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資策略，挖掘并投资于具有良好治理结构、成长性及具有良好发展潜力的中小市值上市公司的股票。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投资策略。

债券投资策略： 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、券种选择策略等。

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。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)

1.本期已实现收益 55,548,504.19

2.本期利润 -62,512,704.54

3.加权平均基金份额本期利润 -0.3639

4.期末基金份额净值 1,611,585,237.89

5.期末基金份额总额 0.922

注:1.本基金的业績指标不包括持有人从购买交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费。

2.本期利润为期间费用实际收入减去期间费用后的余额，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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.2 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.3 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.4 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.5 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.6 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.7 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.8 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.9 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.10 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.11 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.12 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.13 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.14 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.15 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.16 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.17 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.18 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.19 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.20 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.21 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.22 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.23 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.24 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.25 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.26 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.27 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.28 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.29 本报告期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 净值增长 率 净值增长 率 业績比较基 准收益率(%) 准收益率(%) 准收益率(%)

过去三个月 -3.66% 1.10% -5.69% -0.28% 2.93% -0.18%

3.2.30 本报告期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 净