富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金

【2013】第一季度报告

基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年四月二十二日

§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4月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国富恒久信用债券
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月11日
报告期末基金份额总额	317,643,979.40份
投资目标	在有效控制风险并保持资产流动性的基础上,通过积极的投资管理,追求基金资产的长期稳健增值,力争获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	1、资产配置策略 本基金通过综合分析国内外宏观经济形势、利率走势、资金供求关系、证券市场走势、流动性风险、信用风险和有关政策法规等因素,研判各类属固定收益类资产的预期收益和预期风险,确定各类金融资产的配置比例。 2、固定收益类资产投资策略 本基金将灵活运用利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略、相对价值判断等多重投资策略,构建以信用债券为主的固定收益类资产组合。
业绩比较基准	60%×中债企业债总全价指数收益率+40%×中债国债总全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	国富恒久信用债券A类　国富恒久信用债券C类
下属两级基金的交易代码	450018　450019
报告期末下属两级基金的份额总额	238,627,584.65份　79,016,394.75份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)	
	国富恒久信用债券A类	国富恒久信用债券C类
1.本期已实现收益	5,365,546.59	1,693,120.80
2.本期利润	5,218,194.47	1,434,980.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0167	0.0133
4.期末基金资产净值	246,211,198.60	81,401,106.66
5.期末基金份额净值	1.032	1.030

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或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水平要低于所列数字。

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。

3.2 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

1.国富恒久信用债券A类:

阶段	净值增长率①	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	1.47%	0.21%	0.74%	0.04%	0.73%	0.17%

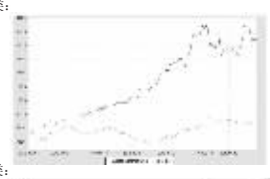
2、国富恒久信用债券C类:

阶段	净值增长率①	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	1.38%	0.20%	0.74%	0.04%	0.64%	0.16%

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

富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012年9月11日至2013年3月31日)

1.国富恒久信用债券A类:



2.国富恒久信用债券C类:

注:1. 本基金的基金合同生效日为2012年9月11日,截至报告期末本基金合同生效未满一年。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. 根据本基金合同,本基金投资组合的范围为"固定收益类金融工具的比例不低于基金资产的80%,其中投资于信用债券的比例不低于固定收益类资产的80%,投资于非固定收益类资产的比例不超过基金资产的20%,其中,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。"

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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刁晖宇	本基金基金经理、固定收益投资总监、QDII投资总监。	2012-9-11	-	14年	刁晖宇先生,美国堪萨斯大学工商管理硕士、美国南方卫理公会大学工程学硕士和上海交通大学工程学学士。曾任美国景顺基金管理公司基金经理,美国Security Benefit Group资深投资分析师,Federal Home Loan Bank资深金融风险及金融衍生产品分析师,湖南中期广州营业部负责人。现任富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金基金经理、国海富兰克林固定收益投资总监以及QDII投资总监。
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,以及富兰克林国海中国收益证券投资基金基金经理。	2012-9-11	-	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。现任富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金基金经理、富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金基金经理,以及富兰克林国海中国收益证券投资基金基金经理。

注: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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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《富兰克林国海恒久信用债券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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司在研究报告发布公平性、投资决策独立性、交易公平分配、信息隔离等方面均能严格执行《公平交易管理制度》,严格按照制度要求对异常交易进行控制和审批。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

央行在2013年一季度总体保持了适当宽松和稳健的货币政策。央行通过调节市场短端利率达到了指导整个市场利率的目的,市场的总体利率保持平稳。企业融资成本高和渠道不畅通等问题在一季度进一步有所改善,但总体的需求不振也影响到实体经济的复苏。1-2月份的工业增加值同比增长9.9%和社会消费品零售总额同比增长12.3%的数据体现了经济复苏的力度不强,房地产和基建投资增速加快带动了总体固定资产投资的快速增长,预计固定资产投资是今年经济的复苏的主要推动力量之一。今年以来的通货膨胀总体符合预期,食品和非食品都没有出现超预期的涨幅,目前通货膨胀压力较小。今年接下来的通胀预期会有所上升,但总体可控。企业债在一季度上升明显,中债企业债总全价指数总体上涨1.2%。国债在一季度则基本持平,中债国债总全价指数上升0.05%。可转债在一季度取得了较大的涨幅,中标可转债指数在一季度上涨了5.63%。本基金根据对信用债总体偏谨慎的看法,在信用债上虽然进行了加仓,但对久期也进行了一定的控制。同时在可转债上涨的时候进行了适时的加仓,基金的净值有所上升。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

国富恒久信用债券基金A类份额2013一季度净值增长1.47%,同期比较基准的收益率0.74%,表现优于基准73个基点。国富恒久信用债券基金C类份额2013一季度净值增长1.38%,同期比较基准0.74%,表现优于基准64个基点。一方面是因为基金在信用债上的配置较基准高,另一方面是国富恒久信用债配置的可转换债券也对业绩有所帮助。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	367,603,718.89	89.44
	其中:债券	367,603,718.89	89.44
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	35,519,373.25	8.64
7	其他各项资产	7,875,232.85	1.92
8	合计	410,998,324.99	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	19,992,000.00	6.10
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	187,524,642.99	57.24
5	企业短期融资券	50,368,000.00	15.37
6	中期票据	21,480,000.00	6.56
7	可转债	88,239,075.90	26.93
8	其他	-	-
9	合计	367,603,718.89	112.21

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	260,070	29,138,242.80	8.89
2	113002	工行转债	212,380	22,943,411.40	7.00
3	1182263	11科伦MTN1	200,000	21,480,000.00	6.56
4	1280360	12张建发债	200,000	20,462,000.00	6.25
5	041258023	12龙盛CP001	200,000	20,200,000.00	6.17
5	122553	12虞交通	200,000	20,200,000.00	6.17

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计	0.00
股指期货投资本期收益	0.00
股指期货投资本期公允价值变动	0.00

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	32,470.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,050,964.74
5	应收申购款	791,797.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,875,232.85

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	29,138,242.80	8.89
2	113002	工行转债	22,943,411.40	7.00
3	110013	国投转债	17,114,636.80	5.22
4	110019	恒丰转债	6,538,420.90	2.00
5	113003	重工转债	1,734,750.00	0.53

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	国富恒久信用债券A类	国富恒久信用债券C类
本报告期期初基金份额总额	389,901,993.59	110,521,599.61
本报告期基金总申购份额	14,251,695.09	77,106,465.57
减:本报告期基金总赎回份额	165,526,104.03	108,611,670.43
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	238,627,584.65	79,016,394.75

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金设立的文件;

2、《富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金基金合同》;

3、《富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金招募说明书》;

4、《富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金托管协议》;

5、中国证监会要求的其他文件。

7.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所并登载于基金管理人网站:www.ftsfund.com。

7.3 查阅方式

1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅,并可按工本费购买复印件。

2、登陆基金管理人网站www.ftsfund.com 查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司
二〇一三年四月二十二日

富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金

【2013】第一季度报告

基金管理人:国海富兰克林基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年四月二十二日

§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4月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	1,070,539,849.52份
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构成的偏差,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标的投资收益,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(国债为主)、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,控制与目标指数的跟踪误差,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(优化调整)及一级市场股票投资。具体而言,基金将基本依据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,基金定期对比检验组合与比较基准的偏离程度,适时对投资组合进行调整,使指数优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参与一级市场股票投资,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资本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,综合考虑中债国债指数各成份券种及金融债的收益率水平、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。 本基金以富兰克林邓普顿投资集团固定收益类资产投资研究平台及本基金管理人的投资研究平台为依托,采取积极主动的投资策略,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、财政政策研判及收益率曲线分析,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。
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年1月1日-2013年3月31日)
1.本期已实现收益	25,566,620.69
2.本期利润	-9,256,670.33
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0087
4.期末基金资产净值	1,001,396,725.27
5.期末基金份额净值	0.935

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或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水平要低于所列数字。

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。

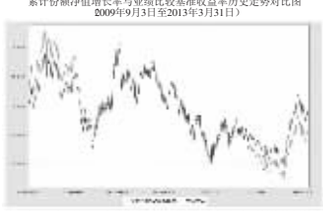
3.2 基金净值表现

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①	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	-1.16%	1.43%	-1.01%	1.48%	-0.15%	-0.05%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2009年9月3日至2013年3月31日)



注:1. 本基金的基金合同生效日为2009年9月3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:

股票资产占基金资产的比例为85%-95%,投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于80%,现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-15%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证占基金资产净值的比例不高于3%。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金不符合上述规定或者基金合同约定的投资组合限制的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵晓东	本基金基金经理、富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金基金经理	2009-9-3	-	9年	赵晓东先生,香港大学MBA,辽宁工程技术大学经济学学士。曾任福博矿业集团项目经理,新江证券分析员,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员。加入国海富兰克林基金管理有限公司后曾任研究员、高级研究员、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金的基金经理助理和富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金的基金经理助理。现任富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金和富兰克林国海中小盘股票型证券投资基金的基金经理。
张志强	本基金基金经理、量化与指数投资总监兼金融工程部总经理,首席数量分析师	2013-3-21	-	10年	张志强先生,CFA,纽约州立大学(布法罗)计算机科学硕士,中国科学技术大学数学专业硕士。曾在美国Enreach Technology Inc.,海通证券股份有限公司、友邦华泰基金管理有限公司工作。2007年4月加入国海富兰克林基金管理有限公司,先后担任风险控制部总经理,业务发展部总经理,现任本基金基金经理,量化与指数投资总监兼金融工程部总经理,首席数量分析师

注: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遵规守信情况的说明

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《富兰克林国海沪深300指数增强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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司在研究报告发布公平性、投资决策独立性、交易公平分配、信息隔离等方面均能严格执行《公平交易管理制度》,严格按照制度要求对异常交易进行控制和审批。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2013年第1季度,国内的证券市场在出现了先扬后抑的走势。一季度业绩基准下跌1.01%。一季度,中央政府的高层领导实现顺利交接,经济政策也开始实施。从宏观经济来看,国内经济出现的复苏不算强劲,同时,2013年春节比去年晚一些,使得较多的基础建设等投资项目也有所推迟。因此,相关投资产业链的复苏也不明显。但是,严厉房地产政策的实施使得大城市的成交量大幅上升,房地产企业的库存降低,也加快了房地产的投资。由于限制"三公"消费,消费数据也低于预期;相比之下,由于季节等因素,外贸数据超预期,弥补了投资和消费增速下滑的不利局面。经济的低位复苏和未来经济增长的不确定性,使得投资者更加钟爱成长股,因此医药和电子,及新兴产业成为市场的热点,周期股等在上涨之后出现了明显的回调。

一季度,从长期投资的角度出发,积极配置了食品饮料的白酒板块和估值优势明显的地产板块;同时,逐渐减持了涨幅过大的银行和市场估值过高的环保等新兴产业板块。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年3月31日,本基金份额净值为0.935元,本报告期份额净值下跌1.16%,同期业绩基准下跌1.01%,落后业绩基准0.15%。由于本基金行业配置较多的白酒板块,是一季度跑输业绩标准的主要原因。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	947,425,759.83	94.13
	其中:股票	947,425,759.83	94.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,076,976.00	0.31
	其中:债券	3,076,976.00	0.31
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	1,700,000.00	0.17
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	52,798,293.41	5.25
7	其他各项资产	1,501,502.54	0.15
8	合计	1,006,502,531.78	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,695,000.00	0.37
C	制造业	105,485,724.10	10.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	41,232,269.20	4.12
K	房地产业	15,441,760.71	1.54
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	165,854,754.01	16.56

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,179,402.75	0.42
B	采矿业	70,360,809.35	7.03
C	制造业	269,796,159.72	26.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,420,520.69	2.24
E	建筑业	27,995,890.70	2.80
F	批发和零售业	20,997,038.97	2.10
G	交通运输、仓储和邮政业	19,634,353.12	1.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,831,461.13	1.38
J	金融业	270,904,373.03	27.05
K	房地产业	41,760,073.11	4.17
L	租赁和商务服务业	4,091,831.68	0.41
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,350,628.81	0.53
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	1,479,278.40	0.15
S	综合	8,769,184.36	0.88
	合计	781,571,005.82	78.05

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600000	浦发银行	2,708,359	27,435,676.67	2.74
2	600036	招商银行	2,141,500	27,047,145.00	2.70
3	600016	民生银行	2,242,728	21,619,897.92	2.16
4	601328	交通银行	4,203,569	19,798,809.99	1.98
5	601318	中国平安	458,053	19,132,873.81	1.91
6	601818	光大银行	5,918,461	19,057,444.42	1.90
7	000002	万 科A	1,354,774	14,577,368.24	1.46
8	601166	兴业银行	825,827	14,286,807.10	1.43
9	601939	建设银行	2,881,078	13,195,337.24	1.32
10	601601	中国太保	688,852	12,599,103.08	1.26

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600809	山西汾酒	1,986,040	59,601,060.40	5.95
2	601166	兴业银行	999,963	17,299,359.90	1.73
3	600000	浦发银行	1,521,610	15,413,909.30	1.54
4	000002	万 科A	996,700	10,724,492.00	1.07
5	002304	洋河股份	160,000	9,979,200.00	1.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	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	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,076,976.00	0.31
8	其他	-	-
9	合计	3,076,976.00	0.31

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	29,050	3,076,976.00	0.31
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计	0.00
股指期货投资本期收益	0.00
股指期货投资本期公允价值变动	0.00

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金不投资股指期货。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	102,902.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,751.42
5	应收申购款	1,386,848.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,501,502.54

5.9.4 报告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的可转换债券。

5.9.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,046,139,182.18
本报告期基金总申购份额	196,240,060.00
减:本报告期基金总赎回份额	171,839,392.66
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,070,539,849.52

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金设立的文件;

2、《富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》;

3、《富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书》;

4、《富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金托管协议》;

5、中国证监会要求的其他文件。

7.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所并登载于基金管理人网站:www.ftsfund.com。

7.3 查阅方式

1、投资者在基金开放日内至基金管理人或基金托管人住所免费查阅,并可按工本费购买复印件。

2、登陆基金管理人网站www.ftsfund.com查阅。

国海富兰克林基金管理有限公司
二〇一三年四月二十二日

富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金

【2013】第一季度报告

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:二〇一三年四月二十二日

§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、准确性和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本基金合同规定,于2013年4月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国富潜力组合股票
基金主代码	450003
交易代码	450003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月22日
报告期末基金份额总额	4,050,