

富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金

【2013】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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十三日

§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10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,也不保证过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|-----------------|
| 基金名称 | 国海富兰克林策略回报混合 |
| 基金代码 | 450010 |
| 交易代码 | 450010 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011年8月22日 |
| 报告期末基金份额总额 | 391,512,807.41份 |

投资目标
本基金基于对宏观经济和证券市场长期趋势的判断,采用基金中长期资产配置策略,在追求基金资产长期增值的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。
本基金基于对宏观经济和证券市场长期趋势的判断,采用基金中长期资产配置策略,在追求基金资产长期增值的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。
本基金基于对宏观经济和证券市场长期趋势的判断,采用基金中长期资产配置策略,在追求基金资产长期增值的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。

投资策略
本基金基于对宏观经济和证券市场长期趋势的判断,采用基金中长期资产配置策略,在追求基金资产长期增值的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。
本基金基于对宏观经济和证券市场长期趋势的判断,采用基金中长期资产配置策略,在追求基金资产长期增值的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。
本基金基于对宏观经济和证券市场长期趋势的判断,采用基金中长期资产配置策略,在追求基金资产长期增值的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×40%+中国国债指数收益率×60%。
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×40%+中国国债指数收益率×60%。
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×40%+中国国债指数收益率×60%。

风险收益特征
本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和股票型基金,低于股票型基金。
本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和股票型基金,低于股票型基金。
本基金为混合型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和股票型基金,低于股票型基金。

基金管理人
基金托管人
国海富兰克林基金管理有限公司
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7月1日-2013年9月30日) |
|----------------|---------------------------|
| 1.本期已实现收益 | -23,348,122.14 |
| 2.本期利润 | 28,193,778.07 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0685 |
| 4.期末基金资产净值 | 348,967,169.39 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.891 |

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 8.00% 1.10% 4.37% 0.86% 3.63% 0.24%

3.2.2 自基金合同生效以来本基金基金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
富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金
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
2011年8月2日至2013年9月30日

注:本基金的基金合同生效日为2011年8月2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。
§4 管理人报告
4.1 基金经理报告
基金经理:朱国庆

姓名 职务 任职日期 离任日期 说明
朱国庆 公司权益投资总监,国海富兰克林策略回报混合基金基金经理 2011-8-2 - 15年

姓名 职务 任职日期 离任日期 说明
王瑞宇 公司研究分析部副经理,国海富兰克林策略回报混合基金基金经理 2013-7-30 - 10年

注:表中“证券从业年限”的计算标准为该名员工从事过所有诸如基金、证券、投资等相关金融领域的工作年限的总和。
4.2 报告期内本基金投资运作遵规守信情况的说明
4.3 公平交易专项说明
4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.13 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.14 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.15 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.16 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.17 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.18 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.19 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.20 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.21 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.22 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.23 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.24 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.25 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.26 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.27 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.28 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.29 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.30 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.31 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.32 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.33 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.34 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.35 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.36 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.37 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.38 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.39 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.40 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.41 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.42 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.43 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.44 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.45 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.46 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.47 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.48 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.49 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.50 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.51 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.52 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.53 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.54 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.55 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.56 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.57 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.58 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.59 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.60 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.61 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.62 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.63 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.64 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.65 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.66 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.67 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.68 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.69 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.70 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.71 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.72 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.73 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.74 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.75 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.76 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.77 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.78 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.79 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.80 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.81 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.82 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.83 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.84 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.85 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.86 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.87 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.88 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.89 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.90 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.91 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.92 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.93 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.94 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.95 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.96 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.97 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.98 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.99 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
5.00 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
5.01 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

5.02 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
5.03 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
5.04 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
5.05 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

5.06 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
5.07 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
5.08 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
5.09 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

5.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
5.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
5.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
5.13 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

5.14 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
5.15 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
5.16 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
5.17 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 253,714,459.28 | 72.16 |
| | 其中:股票 | 253,714,459.28 | 72.16 |
| 2 | 固定收益投资 | 57,081,263.30 | 16.23 |
| | 其中:债券 | 57,081,263.30 | 16.23 |
| 3 | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 39,990,734.34 | 11.37 |
| 6 | 其他各项资产 | 829,759.91 | 0.24 |
| 7 | 合计 | 351,616,216.83 | 100.00 |

| 序号 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农林牧渔 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 200,703,003.06 | 57.51 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 10,132,759.68 | 2.90 |
| 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 | 11,534,380.15 | 3.31 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 24,332,180.14 | 6.97 |
| 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 | 7,012,136.25 | 2.01 |
| 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 | | 253,714,459.28 | 72.70 |

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

| 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 | 600276 | 恒瑞医药 | 566,231 | 20,593,821.47 | 5.90 |
| 2 | 600383 | 金地集团 | 3,136,907 | 18,884,180.14 | 5.41 |
| 3 | 002385 | 大北农 | 1,451,449 | 18,651,119.65 | 5.34 |
| 4 | 300119 | 瑞普生物 | 621,682 | 14,906,876.54 | 4.18 |
| 5 | 000663 | 中兴通讯 | 845,008 | 14,027,132.80 | 4.02 |
| 6 | 600312 | 平安水电 | 1,395,460 | 13,354,552.20 | 3.69 |
| 7 | 300033 | 聚飞光电 | 383,327 | 12,885,693.43 | 3.63 |
| 8 | 600406 | 国电南瑞 | 798,227 | 11,534,380.15 | 3.31 |
| 9 | 000422 | 科伦药业 | 196,918 | 10,574,406.00 | 3.03 |
| 10 | 600597 | 光明乳业 | 410,045 | 9,672,961.55 | 2.77 |

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 | 9,508,000.00 | 2.72 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 19,950,000.00 | 5.72 |
| | 其中:政策性金融债 | 19,950,000.00 | 5.72 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 10,006,000.00 | 2.87 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 17,617,263.30 | 5.05 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 57,081,263.30 | 16.36 |

5.5 报告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

| 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 | 130201 | 13国债01 | 200,000 | 19,950,000.00 | 5.72 |
| 2 | 110015 | 石化转债 | 179,970 | 17,617,263.30 | 5.05 |
| 3 | 071307008 | 13中债转债CP008 | 100,000 | 10,006,000.00 | 2.87 |
| 4 | 130011 | 13附息国债11 | 100,000 | 9,508,000.00 | 2.72 |
| 5 | - | - | - | - | - |

5.6 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资产支持证券投资明细
5.7 报告期末未持有资产支持证券
5.8 报告期末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
5.9 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明
5.10 报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明
5.11 报告期内本基金投资的期权交易情况说明
5.12 本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.13 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.14 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.15 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.16 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.17 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.18 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.19 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.20 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.21 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.22 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.23 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.24 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.25 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.26 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.27 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.28 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.29 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.30 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.31 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.32 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.33 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.34 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.35 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.36 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.37 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.38 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.39 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.40 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.41 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.42 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.43 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.44 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.45 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.46 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.47 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.48 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.49 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.50 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.51 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.52 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.53 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.54 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.55 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.56 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.57 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.58 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.59 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.60 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.61 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.62 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.63 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.64 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.65 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.66 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.67 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.68 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.69 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.70 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.71 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.72 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.73 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.74 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.75 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.76 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.77 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.78 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.79 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.80 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.81 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.82 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.83 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.84 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.85 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.86 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.87 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.88 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.89 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.90 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.91 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.92 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.93 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

5.94 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.95 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例
5.96 报告期内本基金投资的资产支持证券品种、数量、公允价值、占基金资产净值比例

富兰克林国海亚洲 除日本 机会股票型证券投资基金

【2013】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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十三日

§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10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,也不保证过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|----------------|
| 基金名称 | 国富亚洲机会股票(QDII) |
| 基金代码 | 457001 |
| 交易代码 | 457001 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年2月22日 |
| 报告期末基金份额总额 | 58,712,990.67份 |

投资目标
本基金的投资目标是:通过投资在亚洲地区(不包括日本)证券市场发行交易以及公司总部或经营实位于亚洲地区(不包括日本)上市公司以实现基金资产的长期增值。
本基金的投资目标是:通过投资在亚洲地区(不包括日本)证券市场发行交易以及公司总部或经营实位于亚洲地区(不包括日本)上市公司以实现基金资产的长期增值。
本基金的投资目标是:通过投资在亚洲地区(不包括日本)证券市场发行交易以及公司总部或经营实位于亚洲地区(不包括日本)上市公司以实现基金资产的长期增值。

投资策略
本基金的投资目标是:通过投资在亚洲地区(不包括日本)证券市场发行交易以及公司总部或经营实位于亚洲地区(不包括日本)上市公司以实现基金资产的长期增值。
本基金的投资目标是:通过投资在亚洲地区(不包括日本)证券市场发行交易以及公司总部或经营实位于亚洲地区(不包括日本)上市公司以实现基金资产的长期增值。
本基金的投资目标是:通过投资在亚洲地区(不包括日本)证券市场发行交易以及公司总部或经营实位于亚洲地区(不包括日本)上市公司以实现基金资产的长期增值。

业绩比较基准
MSCI亚洲(除日本)净总收益指数
本基金业绩比较基准为:MSCI亚洲(除日本)净总收益指数×80%+人民币定期存款利率×20%。
本基金业绩比较基准为:MSCI亚洲(除日本)净总收益指数×80%+人民币定期存款利率×20%。
本基金业绩比较基准为:MSCI亚洲(除日本)净总收益指数×80%+人民币定期存款利率×20%。

风险收益特征
本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,低于股票型基金。
本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,低于股票型基金。
本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金,低于股票型基金。

基金管理人
基金托管人
国海富兰克林基金管理有限公司
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 |
|--------|-----------|
|--------|-----------|