富兰克林国海潜力组合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。

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7月1日起至9月30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	3,697,697,769.23份
投资目标	注重基金资产长期增值，投资未来收益具有成长性和资产价值低估的上市公司股票，为投资者赚取长期稳定的资本增值。
投资策略	资产配置策略： 本基金采用“自下而上”的组合构建方法，从上市公司的具体发展前景和未来的盈利分析，到行业的发展趋势，再到宏观经济形势，确定大类资产的配置。 在运用了“自下而上”策略之后，根据市场环境的变化，市场出现的各种套利机会和未来的发展趋势判断，确定本基金资产配置最终的选择标准。 股票选择策略： 本基金将运用定性和定量方法，通过对上市公司的财务分析和增长潜力分析，挑选出其中股价下跌风险最低且上涨空间最大的股票构建具体的股票组合。 债券投资策略： 本基金的债券投资为股票投资由于市场条件所限，不易实施预定投资策略时，使部分资产保值增值的防守性措施。
业绩比较基准	85%×MSCI中国A股指数+ 10%×中债国债总指数(全价)+ 5%×同业存款息率
风险收益特征	本基金是一只主动型投资的股票型基金，属于基金类型中具有中高等级风险的基金品种，本基金的风险与预期收益都高于混合型基金。
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	-104,788,024.00
2.本期利润	480,897,194.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.1264
4.期末基金资产净值	3,847,975,778.28
5.期末基金份额净值	1.0406

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。

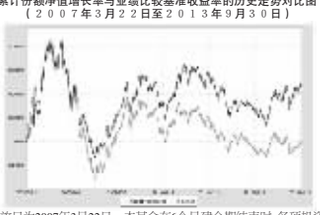
3.2 基金净值表现

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	13.74%	1.23%	9.13%	1.17%	4.61%	0.06%

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

富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金
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
（2007年3月22日至2013年9月30日）



注：本基金的基金合同生效日为2007年3月22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（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	任本基金的基金经理期限 离任日期	证券从业年限	说明
朱国庆	公司权益投资总监，国富潜力组合股票基金和国富策略回报混合基金的基金经理	2007-3-22	-	15年	朱国庆先生，CFA，CPA，复旦大学应用经济学硕士。历任上海浦东发展银行社会保险基金部投资经理，大鹏证券有限公司投资银行部项目经理，平安证券有限公司销售交易部门负责人，国海证券有限责任公司基金公司筹备组成员，国海富兰克林基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理。现任国海富兰克林基金管理有限公司权益投资总监，国富潜力组合股票基金和国富策略回报混合基金的基金经理。

注：表中“任职从业年限”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《富兰克林国海潜力组合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 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《关于反向交易管理办法》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同日反向交易且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3季度股票市场持续上扬，沪深300指数在期间上涨9.47%。宏观经济数据短期企稳，在一定程度上化解了投资者对中国经济过于悲观的预期；央行通过公开市场操作维持较低的利率水平，市场流动性维持宽裕局面。投资者对经济前景的谨慎预期导致周期性行业被市场逐步抛弃，稀缺的成长股估值持续提升；同时，对于经济改革的憧憬与期待也使得各类题材股保持活跃局面。本季度表现突出的行业有信息服务、信息设备、商业贸易、餐饮旅游、交通运输、农业、纺织服装、医药等，而传统周期性行业如建筑建材、采掘、钢铁等则落后市场。本基金3季度维持了较高股票仓位，在医药、大众食品、TMT、农业等行业的成长股配置比例较高，这些成长股表现较好是本报告期基金业绩战胜业绩基准的主要原因。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.0406元，本报告期净值增长率为13.74%，同期业绩比较基准增长率为9.13%，本基金战胜业绩比较基准4.61%。

§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	3,408,808,535.37	83.68
	其中：股票	3,408,808,535.37	83.68
2	固定收益投资	148,035,000.00	3.63
	其中：债券	148,035,000.00	3.63
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	191,400,000.00	4.70
	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	302,983,499.08	7.44
6	其他各项资产	22,316,462.24	0.55
7	合计	4,073,543,496.69	100.00

5.2 报告期末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	14,866,278.20	0.39
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,882,196,037.82	74.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	126,888,583.64	3.30
F	批发和零售业	7,166,280.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	140,905,120.72	3.66
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	-	-
K	房地产业	136,615,602.19	3.55
L	租赁和商务服务业	100,170,632.80	2.60
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	3,408,808,535.37	88.59

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	9,012,990	327,802,446.30	8.52
2	000063	中兴通讯	15,722,030	260,985,698.00	6.78
3	002385	大北农	15,578,911	200,189,006.35	5.20
4	002422	科伦药业	2,854,881	153,307,109.70	3.98
5	600585	海螺水泥	10,017,139	149,656,056.66	3.89
6	601006	大秦铁路	19,355,099	140,905,120.72	3.66
7	002022	科华生物	7,979,758	133,660,946.50	3.47
8	300303	聚飞光电	5,578,334	123,225,398.06	3.20
9	600312	平高电气	12,118,465	115,973,710.05	3.01
10	600418	江淮汽车	11,862,199	109,488,096.77	2.85

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	148,035,000.00	3.85
	其中：政策性金融债	148,035,000.00	3.85
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	148,035,000.00	3.85

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	130410	13农发10	1,000,000	98,160,000.00	2.55
2	130201	13国开01	500,000	49,875,000.00	1.30
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
根据基金合同，本基金不投资股指期货。

5.9 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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：

四川科伦药业股份有限公司2013年5月21日公告披露，于2013年5月20日收到中国证监会稽查总队的《调查通知书》，因涉嫌信息披露违法违规，中国证监会决定对其立案调查。科伦药业表示主要是公司2011年收购崇州君健塑胶有限公司时存在未真实、准确、完整披露交易对方的情况及交易双方之间的关联关系的问题，公司决定就收购君健塑胶100%股权事项按照关联交易的决策程序重新履行审议程序，并于2013年5月30日获得了股东大会表决通过。截至本报告期末，立案调查仍在进行中，暂无相关事项公告。

本基金对科伦药业投资决策说明：本公司的投研团队经过充分调研，本基金通过长期跟踪该公司认为科伦药业符合本基金价值投资的理念，对该股的投资决策遵循公司投资制度的规定。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	924,192.57
2	应收证券清算款	18,250,930.59
3	应收股利	-
4	应收利息	2,274,741.81
5	应收申购款	866,597.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,316,462.24

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期内未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票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	3,867,101,057.54
本报告期基金总申购份额	42,589,337.96
减：本报告期基金总赎回份额	211,992,626.27
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,697,697,769.23

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内未有基金管理人运用固有资金投资本公司管理的该基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会批准富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金设立的文件；
2、《富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金基金合同》；
3、《富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金招募说明书》；
4、《富兰克林国海潜力组合股票型证券投资基金托管协议》；
5、中国证监会要求的其他文件。

8.2 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。

8.3 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
二〇一三年十月二十三日

富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金

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。

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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国富强化收益债券
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月24日
报告期末基金份额总额	129,643,494.45份
投资目标	通过主动的资产管理，在严格控制风险、保证资产充分流动性的基础上，力求为投资者创造持续稳定的投资回报。
投资策略	固定收益类品种投资策略： 本基金将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。 动态收益增强策略： 本基金根据债券市场的动态变化，采取多种灵活的策略，获取超额收益。 股票投资策略： 本基金主要采用“自下而上”的投资策略，将定量的股票筛选和定性的公司深度研究相结合，精选具有稳定的现金分红能力和持续的盈利增长预期，且估值合理的优质上市公司股票。 可转债投资策略： 可转换债券（含可交易分离可转债）兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险，分享股票价格上涨收益的特点。可转债的选择结合其债性和股性特征，在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析，投资具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券，获取稳健的投资回报。
业绩比较基准	中债总指数(全价)
风险收益特征	本基金属债券型证券投资基金，属于证券投资基金中的低风险品种。本基金长期平均的风险和预期收益低于混合型基金，高于货币市场基金。
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
下属两级基金的基金简称	国富强化收益债券A / 国富强化收益债券C
下属两级基金的交易代码	450005 / 450006
报告期末下属两级基金的份额总额	117,655,683.30份 / 11,987,811.15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7月1日-2013年9月30日) 国富强化收益债券A	国富强化收益债券C
1.本期已实现收益	1,186,034.66	79,804.55
2.本期利润	-438,812.21	-30,646.15
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0036	-0.0033
4.期末基金资产净值	130,352,426.43	13,139,970.46
5.期末基金份额净值	1.1079	1.0961

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、国富强化收益债券A：

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	-0.32%	0.17%	-2.68%	0.09%	2.36%	0.08%

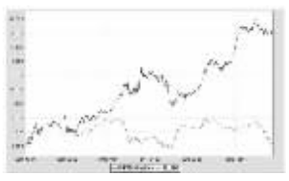
2、国富强化收益债券C：

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	-0.40%	0.17%	-2.68%	0.09%	2.28%	0.08%

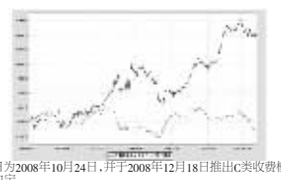
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

富兰克林国海强化收益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
（2008年10月24日至2013年9月30日）

1.国富强化收益债券A：



2.国富强化收益债券C：



注：本基金的基金合同生效日为2008年10月24日，并于2008年12月18日推出C类收费模式。本基金在3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（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	任本基金的基金经理期限 离任日期	证券从业年限	说明
刘怡敏	国富中国收益混合基金、国富强化收益债券基金和国富恒久信用债券基金的基金经理	2008-10-24	-	10年	刘怡敏女士，CFA，四川大学金融学硕士。历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。现任国海富兰克林基金管理有限公司国富中国收益混合基金、国富强化收益债券基金和国富恒久信用债券基金的基金经理。

注：表中“任职从业年限”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《富兰克林国海强化收益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《关于反向交易管理办法》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同日反向交易且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

三季度，受6月“钱荒”影响，市场对资金面担忧较强，债市一路走低。经济受到补库存的需求的拉动出现一拨反弹，股市随之在6月的低点开始反弹。考虑到资金成本处在高位，我们在三季度仍然维持了比较低的杠杆率。我们在三季度增持了下跌较多的利率债，经过调整，利率产品收益率仍处在高位，具备一定的投资价值。三季度我们对组合权益持仓进行了调整，增持了一部分估值较低且业绩成长更为明确的个股，对于部分估值偏高的个股，我们进行了减持。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内，强债基金A类净值变化率为-0.32%，同期比较基准收益率为-2.68%，超越比较基准236个基点。强债基金C类报告期内净值变化率为-0.40%，同期比较基准收益率为-2.68%，落后比较基准228个基点。基金收益战胜基准的原因是三季度债市大幅下挫，基金的组合久期短于比较基准，因此在下跌中具有更强的防御性质。

§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	13,753,230.82	7.78
	其中：股票	13,753,230.82	7.78
2	固定收益投资	155,362,085.95	87.83
	其中：债券	155,362,085.95	87.83
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	2,000,000.00	1.13
	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	2,586,226.50	1.46
6	其他各项资产	3,178,392.70	1.80
7	合计	176,879,935.97	100.00

5.2 报告期末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	-	-
C	制造业	9,286,326.32	6.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,752,904.50	2.62
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	714,000.00	0.50
K	房地产业	-	-
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	13,753,230.82	9.58

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	000651	格力电器	189,967	5,045,523.52	3.52
2	600863	内蒙华电	1,120,270	3,752,904.50	2.62
3	000568	泸州老窖	104,948	2,214,402.80	1.54
4	002563	森马服饰	80,000	2,026,400.00	1.41
5	601318	中国平安	20,000	714,000.00	0.50
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

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	6,971,300.00	4.86
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,223,000.00	20.37
	其中：政策性金融债	29,223,000.00	20.37
4	企业债券	90,035,366.75	62.75
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	19,950,000.00	13.90
7	可转债	9,182,419.20	6.40
8	其他	-	-
9	合计	155,362,085.95	108.27

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	130318	13进出18	300,000	29,223,000.00	20.37
2	122127	11欧亚债	110,970	11,690,689.50	8.15
3	124078	12云城投债	100,000	10,310,000.00	7.19
4	1380262	13阳江债	100,000	10,049,000.00	7.00
5	1280180	12嘉兴经投债	100,000	10,036,000.00	6.99

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
根据基金合同，本基金不投资股指期货。

5.9 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	19,784.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,157,714.36
5	应收申购款	893.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,178,392.70

5.10.4 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	5,579,730.00	3.89
2	110023	民生转债	3,453,638.40	2.41
3	110011	歌华转债	149,050.80	0.10

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十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

项目	国富强化收益债券A	国富强化收益债券C
本报告期期初基金份额总额	123,841,793.64	9,014,439.86
本报告期基金总申购份额	1,001,428.67	3,876,368.99
减：本报告期基金总赎回份额	7,187,539.01	902,997.70
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	117,655,683.30	11,987,811.15

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本报告期内未有基金管理人运用固有资金投资本公司管理的该基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会批准富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金设立的文件；
2、《富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金基金合同》；
3、《富兰克林国海强化收益债券型证券投资基金招募说明书》；
4、《富兰克林国海强化收益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。

8.2 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。

8.3 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
二〇一三年十月二十三日

富兰克林国海深化价值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。

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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国富深化价值股票
基金主代码	450004
交易代码	450004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年7月3日
报告期末基金份额总额	1,479,170,255.20份
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，针对证券市场发展中出现的结构性特征，投资于具有估值优势和成长潜力的上市公司的股票以及各种投资级债券，争取达到基金财产长期稳定增值的目的。
投资策略	本基金采取“自下而上”的选股策略和“自上而下”的资产配置相结合的主动投资管理策略。 股票选择策略： 本基金运用双层次价值发现模型进行股票选择。首先运用数量化的估值方法辨识上市公司的“初级价值”，并选取出估值水平低于市场平均的价值型股票形成初级股票池；之后透过分析初级股票池中上市公司的盈利能力、资产质量、成长潜力等各项动态指标，发掘出目前价值低估、未来具有估值提升空间的股票，也就是在初级价值股票中进行价值精选，发掘上市公司的“深化价值”以形成次级股票池。 资产配置策略： 本基金主要根据宏观经济、政策环境、利率走势、市场资金构成及流动性情况，通过深入的数量化分析和基本面研究，制定本基金股票、债券、现金等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。 债券投资策略： 债券投资组合的回报主要来自于组合的久期管理、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)。为了有助于辨别出恰当的债券久期，并找到构造组合达到这一久期的最佳方法，基金管理人将集中使用基本面分析和技术分析，通过对个券的全面和细致的分析，最后确定债券组合的构成。 权证的投资策略： 对权证的投资建立在对标的证券和组合收益进行分析的基础之上，主要用于锁定收益和控制风险。
业绩比较基准	85% × 沪深300指数+ 15% × 中债国债总指数(全价)
风险收益特征	本基金为价值型股票证券投资基金，具有较高风险和较高收益的特征，其预期的收益和风险都高于混合型基金、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	-28,736,636.64
2.本期利润	166,598,405.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.0887
4.期末基金资产净值	1,791,161,440.68
5.期末基金份额净值	1.211

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。

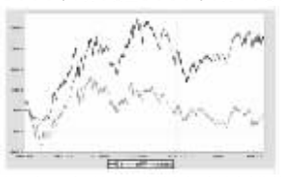
3.2 基金净值表现

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	7.40%	1.04%	7.56%	1.22%	-0.16%	-0.18%

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

富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金
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
（2008年7月3日至2013年9月30日）



注：本基金的基金合同生效日为2008年7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。

§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 任职日期	任本基金的基金经理期限 离任日期	证券从业年限	说明
张晓东	公司副总经理，公募投资决策委员会主席，首席基金经理，国富弹性市值股票基金和国富深化价值股票基金基金经理	2008-7-3	-	20年	张晓东先生，美国多米尼克学院国际经济政治分析硕士。历任中国企业管理无锡培训中心助教，中欧管理研究生项目（现改为中欧国际管理学院）助教/中方院长助理，无锡虹美电器集团销售/项目经理，美国纽堡太平洋投资管理公司高级投资经理，阳光国际管理公司董事，中信资本市场控股公司董事(非董事会成员)，国海富